Ichimoku Kinko Hyo

ایچیموکو

(پایان نامه اثبات پارامترهای متفاوت امروزی برای بهینه کردن عملکرد ایچیموکو)







Linda Hofmann

بسم الله الرحمن الرحیم

عنوان کتاب	نمودار موازنه شده در یک نگاه ایچیموکو لیندا هافمن
مولف	لیندا هافمن
ناشر	فارکس یار
ویراستار	فارکس یار
صفحه آرایی و طرح جلد	فارکس یار
ترجمه	تیم ترجمه فارکس یار
فروشنده	**Seller3**
قیمت	۲۰۰۰۰ تومان
سال انتشار	۱۳۹۸
پایگاه اینترنتی	https://forexyar.com
پست الکترونیکی	info@forexyar.com

لطفا خواهشمند است حق نشر این کتاب را حفظ نمایید

این کتاب با زحمت بسیار و هزینه فراوان تهیه، ترجمه و ارائه گردیده است. لطفا خواهشمند است تا فقط و فقط این کتاب را از سایت رسمی نشریه فارکس یار به آدرس forexyar.com خریداری و دانلود نمایید. تا یاری رسان این موسسه باشید در جهت خدمت رسانی بهتر به جامعه معامله گران و علاقه مندان به کسب دانش در حوزه بازارهای مالی.

با تشکر از شما

فهرست مطالب

فهرست تصاویر

تعریف مسئله

به تازگی، راز چندین ساله تکنیک ژاپنی «Ichimoku Kinko Hyo » در رسانه های غربی به طور گسترده مطرح شده است. برای سرمایه گذاران و معامله گران درک عمیق تر مفاهیم پشت «نمودار ابری» می تواند منافع بزرگی به همراه داشته باشد. کار این تکنیک ایجاد برنامه ای به زبان ساده برای Trade Station در Omega Research است، که آزمایش مهم ترین بازارهای کلیدی در نمودار روزانه و تعیین اینکه آیا فناوری جدید سودآور است یا خیر را امکان پذیر می سازد. این برنامه باید به شکل اصلی آن به کار گرفته شود و نیازی به‌اضافه کردن هیچ نوع مدیریت ریسک و مدیریت مالی دیگری وجود ندارد.

۱. مقدمه

همگی شما نمودار گرافیکی روند قیمت را قبلاً مشاهده کرده اید. ضرب المثل معروفی می‌گوید: «هر تصویر گویای هزاران کلمه است.» اما این تصویر به ما چه می‌گوید؟

در طول زمان، استراتژی های مختلفی برای تفسیر قیمت توسعه یافته اند، و تلاش هایی برای استفاده از این تحلیل ها به منظور انجام پیش بینی دوره های آینده صورت گرفته است. در اینجا به این روش تحلیل تکنیکال (TA) می گوییم، که فرض می کند دوره قیمت سهام نوعی روندهای مشابه خود تشکیل می دهد که در طول زمان تکرار می شوند.

ابداع کننده این روش تحلیل در جهان غرب، چارلز داو بود. او اولین نشریه بازار را با عنوان «نشریه شب مشتریان» منتشر کرد. در سال ۱۸۸۹ نام نشریه به وال استریت ژورنال تغییر یافت. چارلز داو ۲۵۵ مقاله با موضوع مشاهدات خود در این نشریه به چاپ رساند. بعد از درگذشت چارلز داو این روش به نظریه داو معروف شد.

در مشرق زمین، به طور دقیق تر در ژاپن، از قبل اولین نشانه های تحلیل تکنیکال در قرن ۱۶ ام هویدا بود. در ژاپن با برنج معامله می شد. با این وصف و همچنین کمیاب شدن شبه پول، مردم محصولی را که هنوز از زمین برداشت نشده بود می فروختند. به اصطلاح معامله سلف یا معامله پیش فروش انجام می دادند، که سند آن ثبت می شد و سپس معامله انجام می شد. یک بازار اولیه وجود داشت که برنج به صورت کالای فیزیکی معامله می شد و در بازار دوم قراردادهای آتی معامله می شدند. بنابراین در گذر سال ها، استراتژی های مختلفی تکامل یافتند. یکی از آن استراتژی ها Ichimoku Kinko Hyo (IKH) بود. این استراتژی در دهه سی قرن گذشته

توسعه یافت. با این حال، استراتژی یاد شده بسیار ناشناخته و رازآلود مانده است. متون علمی و اسناد به ثبت رسیده بسیار اندکی درباره این موضوع وجود دارد.

در مطالعه حاضر این استراتژی را با جزییات بیشتری بررسی خواهیم کرد. با کمک Easy Language می‌توان برنامه نویسی استراتژی Ichimoku Kinko Hyo را انجام داد. بخشی از این مطالعه ارائه و معرفی این استراتژی از لحاظ ساختار، تفسیر و کاربرد آن است. سپس استراتژی را آزمایش و بر اساس بازارهای مختلف تحلیل می کنیم. هدف مطالعه حاضر این است که تعیین کنیم این استراتژی در کدام بازارها می تواند به کار گرفته شود یا در کدام بازارها رایج است.

۲. تحلیل تکنیکال

۲٫۱ ظهور و شکل گیری در ژاپن و کاربرد امروزی آن

مدت کوتاهی پس از نبرد سکیگاهارا در سال ۱۶۰۰، تاریخ تحلیل تکنیکال در ژاپن باستان آغاز شد. ژنرال توکوگاوا ایه یاسو ژاپن را متحد ساخت و حکومت خود را در توکیو، که در آن زمان ادو نامیده می شد، تشکیل داد. دوران به اصطلاح ادو از سال ۱۶۰۳ تا ۱۸۶۸ به طول انجامید و تا به امروز همچنان به عنوان طولانی‌ترین دوره صلح شناخته می شود. این دوران با انزوای ژاپن از جهان خارج، ثبات داخلی، و شکوفایی فرهنگی، و البته همچنین فئودالیسم و جامعه طبقاتی ارثی مشخص می شد. منبع اصلی درآمد دولت برنج بود، که به‌عنوان مالیات توسط توکوگاوا ایه‌یاسو دریافت می شد. برنج ها انبار می شدند و بعدا دوباره به فروش می رسیدند.

اگر شبه پول و برنج کمیاب می شد، محصول قبل از برداشت فروخته می شد. برای پیش فروش حبوبات، رسید خرید صادر و سپس معامله می شد. اولین قرارداد آتی و همچنین معامله گران آن در این شرایط پا به عرصه وجود گذاردند. تلاش هایی برای تحلیل بازار و سپس پیش بینی چگونگی واکنش عرضه و تقاضا انجام شد. موارد اشاره شده ازجمله امکانات اولیه تحلیل تکنیکال بودند.

تحلیل تکنیکال امروزی از تحلیل قیمت بازار سهام و ارقام کلیدی مختلف به منظور استخراج پیش بینی درباره تحولات آینده قیمت اوراق بهادار، شاخص های بازار سهام، یا دیگر اقلام معاملات مالی پشتیبانی می کند.

در تحلیل تکنیکال دو پرسش مطرح می شود: «چه هنگام بهترین زمان برای سرمایه گذاری است- یا – روند فعلی کدام است؟ و «چه هنگام بستن موضع معاملاتی عاقلانه است- یا – آیا سیگنالی برای معکوس شدن روند وجود دارد؟»

اگر حرکت بازار تخفیفی (Discounted) باشد، مثلاً اخبار مثبت وجود داشته باشد و تقاضا رو به افزایش باشد، بنابراین قیمت پایه صعودی (گاوی) است و قیمت ها افزایش می یابند. با این حال اگر اخبار منفی باشند و عرضه افزایش یابد، قیمت های پایه نزولی (خرسی) خواهد بود و قیمت ها کاهش می یابند. وضعیت توصیف شده یکی از سه فرض مبنای تحلیل تکنیکال است. بیانیه دوم مرز رفتار مشارکت کنندگان بازار را متمایز می سازد. مطابق این بیانیه، حرکت بازار تا زمانی که قیمت مطابق روند حرکت می کند، اساساً به‌جای اینکه معکوس شود، در همان جهت حفظ می شود. آخرین فرض می گوید که، کلید فهم آینده در مشاهده گذشته نهفته است. به‌طور خلاصه، تاریخ تکرار می شود.

تحلیل تکنیکال (TA) ابزارها و مفاهیم متنوعی ارائه می کند که به دلیل اهمیت و ضرورت آنها برای درک عمیق تر IKH، در بخش بعدی با جزییات بیشتری توضیح داده خواهد شد.

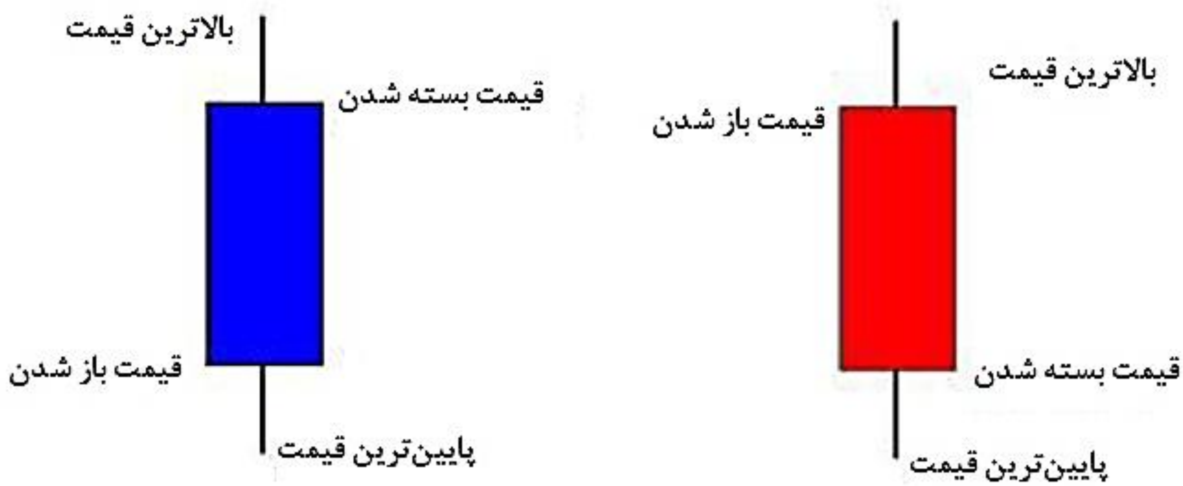
۲٫۲ ابزارها و مفاهیم

۲٫۲٫۱ نمودار شمع

چندین روش برای نمایش قیمت سهام با کمک TA وجود دارد. یکی از این گزینه ها نمودار شمع است، که مانند IKH، ریشه ژاپنی دارد. این روش ها در طول چندین نسل اصلاح و تعدیل شده اند، تا به صورتی که امروز می شناسیم درآمده اند.

نمودارهای شمع، ابزارهایی برای درک بیشتر احساسات و حالت های مشارکت کنندگان بازار هستند. هر شمع تکی یا گروهی، متشکل از دو تا حداکثر پنج شمع است، که احساسات و حالت های مشارکت کنندگان بازار را به صورت واضح نشان می دهد. تنها چند شمع در نمودار بینش های قابل توجه و معنی دار فراهم می کنند. اغلب این تشکیل شمع هاست که حالت و احساسات شرکت کنندگان را مشخص می کند. تکرار شونده ترین تشکیل شمع، شمع های معکوس هستند، که دارای بالاترین سطح وضوح و بیانگری می باشند. ویژگی های توصیف شده بخصوص درباره شمع های آبی در روند نزولی و شمع های قرمز در روند صعودی صادق است. در مورد شمع ها، بدون وجود روند هیچ یک از آنها نمی تواند معکوس شود. این ابزار نه تنها نمای واضحی از

قیمت های باز شدن و بسته شدن [معامله] بلکه بالاترین ها و پایین ترین ها در دوره های از پیش تعریف شده را نیز نشان می دهد. شمع های خالی یا سفید و همین طور شمع های آبی برای افزایش قیمت استفاده می شوند و شمع های پر یا سیاه و شمع های قرمز برای کاهش قیمت استفاده می شود . برای درک بهتر ، به توضیحاتی که بر اساس شمع های روزانه ارائه خواهد شد می پردازیم.



شکل ۱ تشکیل شمع

قیمت باز شدن و قیمت بسته شدن کل بدنه شمع را تشکیل می دهد، که قسمت بالای فتیله شمع نشان دهنده بالاترین قیمت روزانه و ته دنباله شمع نشان دهنده پایین ترین قیمت روز است. اگر قیمت باز شدن پایین تر از قیمت بسته شدن باشد، شمع به رنگ آبی یا سفید نشان داده خواهد شد. این حالت به‌عنوان عملکرد مثبت سهام در معاملات روزانه شناخته می شود. از طرف دیگر، نمایش معکوس، نشان دهنده روند قیمت منفی است، زیرا قیمت بسته شدن پایین تر از قیمت باز شدن بوده است. در این حالت شمع ها به رنگ قرمز یا سیاه نشان داده می شوند. می توان شمع ها را با درنظرگرفتن تشکیل معکوس آنها، به ۷ متغیر (الگو) تقسیم کرد. بسیار مهم است که توجه داشته باشیم که به دلیل اندازه بدنه شمع، نقطه فتیله و نقطه ته شمع بر اساس قیمت باز شدن در انتهای روز متفاوت هستند. تشکیل شمع ها برای تشخیص تغییرات روند استفاده می شود. شمع تراشیده (Marubozu) شمع به شدت صعودی (گاوی) یا به شدت نزولی (خرسی) است.

از طرفی، یک چکش بدنه شمعی کوچکی دارد. دنباله پایینی بسیار طولانی، در حدود سه برابر بدنه شمع است. و از طرف دیگر تنها یک فتیله کوتاه دارد. یک شمع آبی قوی تائید می کند که روند معکوس شده است. اگر در یک روند نزولی با مقیاس بالا اتفاق بی افتد، نشانه دوره گاوی (صعودی) است. پس از باز شدن، قیمت ها روند نزولی می گیرند. که پیامد آن فروش عجولانه است، و خریداران از این موقعیت استفاده می کنند. قیمت بسته شدن در پایان روز به قیمت باز شدن در ابتدای روز نزدیک است. چکش به خودی خود به‌منزله معکوس شدن روند نیست، باید در انتظار روز بعد ماند. در حالت مخالف، هنگامی‌که چکش در روند صعودی اتفاق می افتد، مرد آویزان نامیده می شود. کاهش قیمت شدیدی آغاز می شود، احتمالاً تا زیر قیمت روز قبل. بازار آسیب‌پذیر

است و باید با احتیاط اقدام کرد. اگر قیمت باز شدن و قیمت بسته شدن یکسان باشند، Dragonfly Doji (دوجی سنجاقک) نامیده می‌شود.

چکش رو به بالا شبیه چکش معمولی است، با این تفاوت که فتیله سه برابر بلندتر از بدنه شمع است. یک شمع آبی قوی در روند نزولی، نشان دهنده تغییر احتمالی روند است. خریداران بر بازار تسلط دارند، اما سود را ذخیره می کنند. بازار در شرایط تردید و غیرقابل اعتماد قرار دارد و قیمت بسته شدن نزدیک به قیمت باز شدن است. هنگامی که روز بعد با قیمت بالاتر آغاز می شود و قیمت بسته شدن نیز از آن بالاتر است، یک بازگشت پایین تر محسوب می شود. اگر چکش به صورت سربالا اتفاق بی افتد، ستاره ثاقب نامیده می‌شود. در این وضعیت به‌عنوان فرآیند قدرت خریداران در بالا بردن قیمت تفسیر می شود که خریداران به محیط بازار اعتماد ندارند. در اینجا نیز خریداران ترجیح می دهند سود خود را ذخیره کنند. روز بعد باید در انتظار شمع قرمز بود، زیرا یک بازگشت روبه بالا رخ داده است. قیمت باز شدن و بسته شدن یکسان است که Gravestone Doji (دوجی سنگ قبر) نامیده می شود. نوع بعدی شمع دارای بدنه کوچک و فتیله کوچک و همین‌طور دنباله کوچک است. این شمع نشانه بازگشت روند است. این حالت spinning top (فرفره گردان) نامیده می شود. مهم ترین تشکیل شمع های بازگشت روند شامل ستاره صبح و ستاره شب هستند اولی [ستاره صبح] از سه شمع تشکیل می شود. روند نزولی به گپ یا شکافی بین اولین و دومین شمع منجر می شود. اولین شمع قرمز است که نشان دهنده روند نزولی است. در روز دوم بین کسانی که به دنبال کاهش قیمت (طرفداران بازار خرسی) و کسانی که به دنبال افزایش قیمت هستند (طرفداران بازار گاوی) اختلاف نظر وجود دارد. نتیجه این اختلاف نظر، spinning top (فرفره گردان) است ، که رنگ شمع اهمیتی ندارد، و در روز سوم طرفداران بازار گاوی با شمع آبی قوی بر محیط بازار حاکم می شوند. ستاره شب معادل معکوس یک شمع آبی اولیه در روند صعودی است.

نوع پنجم شمع موج بالا دارای شمع بدنه کوچک با فتیله بلند و دنباله بلند است. این شمع نشان دهنده عدم قطعیت و بی تصمیمی با حاشیه معامله بالا است. طرفداران بازار گاوی قسمت پایین را در اختیار دارند، و قیمت را تعیین می کنند، درحالی که طرفداران بازار خرسی به بازار اعتماد ندارند و سود را ذخیره می کنند. در این حالت قیمت باز شدن و بسته شدن تقریباً برابر است، و بازار کاملاً بی تصمیم است. این شرایط Long Legged Doji یا دوجی پایه بلند نامیده می شود. اگر شمع موج بالا به طور مکرر اتفاق بی افتد، نشان دهنده تغییر روند قریب الوقوع است.

شمع های نوع کاملاً معمولی آبی و قرمز با بدنه شمع، فتیله و دنباله متوسط نشان دهنده روزهای بدون رویدادهای خاص است.

دوجی نوعی شمع را توصیف می کند که قیمت باز شدن و بسته شدن تقریباً یکسان است. شرکت کنندگان در چنین بازاری از نوسانات احساسات و بی تصمیمی بزرگی رنجی می برند. دوجی به‌طور خاص در مواقع بازگشت احتمالی روندها بروز می کند. بخصوص با میزان تغییر کوچک باید منتظر شمع آبی در روزهای آینده باشید که نشان دهنده بازگشت روند است. علاوه بر دوجی های شناخته شده قبلی یک نوع دوجی ۴ قیمتی وجود دارد. چهار قیمت مرتبط : قیمت باز شدن، قیمت بسته شدن، بالاترین قیمت و پایین ترین قیمت روز یکسان هستند. این شرایط عدم قطعیت کامل را در بازار را تضمین می کند.

دیگر الگوهای بازگشتی شامل Engulfing (پوششی)، Harami (باردار)، Piercing Pattern (الگوی نفوذی)، Dark Cloud Cover (پوشش ابر سیاه)، Counterattack Lines (خطوط پاتک)، Three White Soldiers (سه شوالیه سفید)، Three Black Crows (سه کلاغ سیاه)، است که در اینجا به آنها نمی پردازیم.

۲،۲،۲ سطوح حمایت و مقاومت

حمایت و مقاومت از مؤلفه های محوری در تحلیل تکنیکال است. مقاومت زمانی آغاز می شود که در یک روند صعودی قیمت نمی تواند باقیمت بسته شدن از سطح معینی فراتر رود، یعنی مقاومت به‌عنوان مانعی برای قیمت بازار رفتار می کند و می تواند روند صعودی را متوقف کند. از طرف دیگر، حمایت زمانی آغاز می شود که در روند نزولی قیمت بسته شدن نمی تواند از سطح قیمت معینی کاهش بیشتری داشته باشد، یعنی قدرت خرید به اندازه کافی برای متوقف کردن کاهش قیمت بزرگ است. هر دو این خطوط در شرایطی که نقاط عطف بیشتری وجود داشته باشد معنادارتر خواهند بود.

ویژگی های خطوط مقاومت و حمایت در ادامه توضیح داده شده است:

«این خطوط می توانند ایستا (اعداد رند، یا بالاترین در تمام مدت) یا پویا (Kijun-Sen،Kumo ، خط روند) باشند و می توانند به‌وسیله صرفاً نمودار حرکات قیمت یا به وسیله محاسبات (پیوت پوینت، اصلاح فیبوناچی) انجام شود، می تواند به وسیله نمودار اطلاعات (الگوی مثلث) یا تشکیل شمع (pan bottom [کف ماهی‌تابه]) ایجاد شود و اغلب بعد از اولین شکست قیمت هر دو خط، قیمت دوباره آزمایش می شود.»

این معیارها را می توان به‌طور هم زمان برآورده ساخت. این خطوط تنها زمانی ترک خورده یا شکسته در نظر گرفته می شوند که به‌طور قابل توجهی نقض شده باشند. شکستن خطوط مقاومت یا حمایت به تلاش بسیار بیشتری نسبت به واحد زمانی قبلی نیاز دارد. نظر مشارکت کنندگان بازار به وسیله حجم بالایی از معاملات مشخص می شود. اگر نظر بسیاری از مشارکت کنندگان شناسایی شود، شکست روند قابل توجه خواهد بود. اینکه آیا خط مقاومت یا حمایت واقعاً شکسته شده یا خیر به وسیله موضع معاملاتی مخالف آزمایش می شود.

برای معاملات، خطوط مقاومت و حمایت دومین مفاهیم مهم برای نمودار هستند. اولین مفهوم مهم حرکت قیمت است. معاملات همیشه از حرکات قیمت واضح، بدون هیچ گونه تغییر در اندیکاتورهای تحلیل تکنیکال، پیروی می کنند. اگر هر دو خط افقی باشند، نقاط بازگشت قبلی را نشان می دهند که در آن، تنها نقاط مشخص شده مهم ترین هستند. علاوه بر این، قیمت در ناحیه تغییر اهمیت دارد. هر چقدر قیمت به مدت طولانی تری در این ناحیه قرار داشته باشد، اهمیت آن ناحیه بیشتر است. توصیف ها نشان می دهند که هرچقدر حجم معاملاتی که باعث شکست خطوط می شوند بالاتر باشد، شکست روند بیشتر قابل توجه خواهد بود. زیرا به وسیله تمایل تعداد بسیاری از مشارکت کنندگان بازار به وجود آمده است. سطوح قیمتی که محل تلاقی چندین خط مقاومت و حمایت است مقاومت قیمت پایدار نامیده می شود.

۳٫۲٫۲ توقف ها (حد ضررها)

به منظور به حداقل رساندن یا اجتناب از زیان احتمالی، از حد ضررها استفاده می شود، که ابزارهای بی نهایت مهمی هنگام کار با نمودارهای تجزیه و تحلیل هستند. دو نوع حد ضرر مختلف وجود دارد. تفاوت این دو در این است که یک نوع به منظور محدود کردن زیان اعمال می شود و دومی به عنوان توقف تعقیبی (trailing stop) کسب سود. نوع اول به منظور تأمین امنیت سرمایه پس از باز شدن موضع معاملاتی اعمال می شود. این نوع حد ضرر زیان یا بر اساس حداکثر زیان مجاز و یا درصد معینی زیان بر روی قیمت ورود تعیین می شود. در مقابل، با استراتژی توقف تعقیبی برداشت سود، سود در نهایت محدود می شود.

پیش نیاز اجرای این توقف تعقیبی این است که موضع معاملاتی در جهت کسب سود حرکت کند و سپس استاپ محدود کننده زیان به قیمت هزینه اضافه می شود. روش های مختلفی برای تنظیم استاپ وجود دارد. در روش حد زیان متحرک، دستور استاپ زیان آغاز می شود. این روش خود را در جهت کسب سود با افزایش قیمت و اختلاف های از پیش تعیین شده تنظیم می کند. دیگر انواع استاپ شامل استاپ زمانی، استاپ کسب سود، استاپ فراریت است. در استاپ زمانی، مدت زمان مشخصی تعریف می شود که در آن موضع معاملاتی بسته خواهد شد اگر هنوز به سود نرسیده باشد. در استاپ کسب سود مقدار سود هدف تعریف می شود. محدودیت فروش برای موضع معاملاتی خرید و یک محدودیت خرید برای موضع معاملاتی فروش تعیین می شود. در استاپ فراریت، محدوده استاپ تعریف می شود. این محدوده با توجه به فراریت دوره قبلی تعریف می شود. به علاوه می توانید حد ضررهایی در مجاورت حمایت ها و مقاومت ها تعریف کنید، یعنی اعداد رند، خطوط روند، Kijun-Sen و سایر موارد. تمام این موارد تنها در یک جهت- در جهت برنده شدن، دنبال می شوند.

۳. ایچیموکو کینکو هایو (Ichimoku Kinko Hyo)

一目均衡表

شکل ۲ IKH در KANJI

۳٫۱. توسعه و شکل‌گیری

IKH (Ichimoku Knko Hyo) در دهه سی قرن گذشته توسط روزنامه نگار ژاپنی گوئیچی هوسودا توسعه یافت، که آن را Ichimoku Sanjin نامید و در ۱۹۶۸ منتشر ساخت. این روش یکی از تکنیک های اندیکاتور است که در حوزه معاملات ژاپنی بسیار پرطرفدار می باشد. گوئیچی هوسودا هنوز با احترام «استاد» خطاب می شود و آثار او به ندرت در دسترس عموم قرار دارد. ترجمه تحت الفظی IKH، به معنی «نمودار موازنه شده در یک نگاه» است و برای کاربر امکان خواندن واضح و روشن سیگنال های خرید و فروش، قدرت روندها، جهت روندها، و همچنین سطوح مقاومت و حمایت را فراهم می کند.

۳٫۲. ایجاد نمودار

مبنای IKH شمع های فهرست شده در بخش ۲٫۲٫۱. است. هنگام به‌کارگیری IKH پنج خط و یک ابر در نمودار نشان داده می شود. ابر مؤلفه مرکزی تکنیک اندیکاتور است، که با جزییات بیشتری در ادامه ارائه می شود. از طرفی چهار خط از پنج خط، نشان دهنده مقدار میانگین بالاترین و پایین ترین قیمت های روزانه هستند. از خطوط میانگین در این روش استفاده می شود، زیرا دنبال کننده معتبر روند است. اگر روند یک طرفه باشد، IKH نتایج کافی تولید نمی کند. دو تنظیم پیش فرض برای این روند بخصوص وجود دارد. از طرفی، مبنای روزانه استانداردی برای افق زمانی است. این مبنا می تواند برای مناطق زمانی مختلف استفاده شود. متغیر زمانی دوم دوره های ۹، ۲۶ و ۵۲ برای اندیکاتورهاست. دوره های انتخاب شده بر مبنای ۶ روز معاملاتی هفته است، یعنی ۹ روز نشان دهنده ½ ۱ هفته، ۲۶ روز نشان دهنده یک ماه کاری ژاپنی است و ۵۲ تعداد روزهای دو ماه کاری است. با توجه به هفته معاملاتی امروزی که ۵ روز است، دوره ها باید به ۸، ۲۲ و ۴۴ روز تطبیق داده شوند.

با این حال، ژاپنی ها هنوز از دوره های اصلی استفاده می کنند. بنابراین منطقی به نظر می رسد که کار را با دوره های معمولی ادامه داد. در بخش بعدی نحوه محاسبه هر یک از خطوط توضیح داده شده است. محاسبات همیشه شامل روز جاری است.

Kijun- Sen (خط پایه)

Kijun- Sen (STL) میانگین پایین ترین و بالاترین قیمت ۲۶ روز گذشته است. می توان جهت بازار را با استفاده از جهت Kijun- Sen ارزیابی کرد. با این حال، در طول این محاسبات به کندی واکنش نشان خواهد داد.

Tenkan- Sen

میانگین بالاترین و پایین ترین قیمت ۹ روز گذشته Tenkan- Sen (DRL) یا خط چرخش نامیده می شود. این خط یا در حال صعود و یا در حال افت است. و به ندرت در وضعیت افقی قرار می گیرد. Tenkan- Sen به عنوان نوعی اندیکاتور اولیه یا خط سیگنال عمل می کند، زیرا قبل از خط Kijun- Sen از قیمت بازار عبور می کند و بنابراین شکست احتمالی روند قابل مشاهده خواهد بود.

Senkou Span 1

خط میانگین به وسیله خط Kijun-Sen و Tenkan-Sen تشکیل می شود. این خط Senkou Span 1 (S1) یا خط مقدم اول نامیده می شود. این مقدار میانگین برای ۲۶ روز آینده پیش بینی می شود.

Senkou Span 2

مقدار میانگین بر اساس بالاترین و پایین ترین قیمت ۵۲ روز گذشته محاسبه می شود و برای ۲۶ روز آینده نیز پیش بینی می شود. این خط با نام Senkou Span 2 (S2) یا خط مقدم دو شناخته می شود. تا زمانی که هیچ بالاترین یا پایین ترین قیمت جدیدی در طول ۵۲ روز گذشته ایجاد نشده باشد به‌طور افقی امتداد می یابد.

Kumo (ابر)

Kumo به معنای ابر است. ابر مؤلفه مرکزی این استراتژی است و به همین دلیل در اینجا درباره نمودار ابر نیز بحث خواهیم کرد. ابر ناحیه بین Senkou Span 1 و Senkou Span 2 را می پوشاند و به عنوان فیلتری برای سیگنال های خرید و فروش عمل می کند.

این ناحیه نشان دهنده ۲۶ دوره قبل ، و نشان دهنده سطح مقاومت و حمایت است و همچنین نشان می دهد که آیا سیگنال و/یا تغییر روندی وجود دارد.

Chikou Span

Chikou Span (CS) یا خط متأخر قیمت های کنونی را برای ۲۶ دوره به عقب شیفت می دهد. این خط به‌عنوان فیلتری برای ارزیابی سیگنال های خرید و فروش عمل می کند.

۳٫۳ چشم اندازهای پنج خط و ابر

جهت روند



شکل ۳ جهت های روند

ما صرفاً سیگنال های موضع معاملاتی خرید (سیگنال های خرید) را دنبال می کنیم ، هنگامی‌که در روند صعودی قرار داریم، یعنی هنگامی‌که قیمت کنونی بالاتر از ابر است. اگر قیمت کنونی پایین تر از ابر باشد ما در روند نزولی قرار داریم و تنها سیگنال های موضع معاملاتی فروش (سیگنال های فروش) را دنبال می کنیم. با این حال، اگر قیمت در ابر قرار داشته باشد، سه احتمال وجود دارد. اگر روند یک طرفه ای وجود داشته باشد، در ابتدا هیچ اقدامی انجام نمی شود. احتمال دوم این است که قیمت از بالا وارد ابر شده است، بنابراین ما سیگنال های موضع معاملاتی خرید را دنبال می کنیم. در حالت سوم، قیمت از پایین وارد ابر می شود و ما سیگنال های موضع معاملاتی فروش را دنبال می کنیم. در دو حالت آخر، باید به زمان ورود قیمت به ابر توجه کنیم، اگر قیمت برای مدتی در ابر باقی مانده باشد در این صورت بهتر است هیچ اقدامی انجام نشود. حالا در اینجا دو خط مرزی ابر، یعنی Senkou Span 1 و Senkou Span 2 را در نظر می گیریم. این دو خط نشان دهنده روند کوتاه مدت (Senkou Span 1) و روند طولانی تر (Senkou Span 2) هستند. اگر خط Senkou Span 1 بالا باشد، بازار صعودی (گاوی) ارزیابی می شود و اگر Senkou Span 2 بالا باشد، بازار نزولی (خرسی) است. اگر روند در حال صعود باشد، ابر صعودی (گاوی)، و اگر روند در حال نزول باشد ابر نزولی (خرسی) است.

قدرت روند

خط Kijun-Sen می تواند در سه حالت قرار بگیرد: بالارونده، پایین رونده، و افقی. موقعیت افقی برای سطح مقاومت یا حمایت اهمیت دارد. بنابراین خط Kijun-Sen خط دفاع روند قیمت نیز نامیده می شود. اگر به‌طور پیوسته صعودی و زیر قیمت باشد، در روند صعودی قرار داریم. اگر اصلاح های کوچکی وجود داشته باشد، خط صعودی صاف تر و حتی افقی می شود. بهترین زاویه شیب بین 33° و 45° است. اگر زاویه از این تندتر باشد، بازار بیش ازحد برافروخته است. در زاویه بازتر قیمت مومنتوم خود را از دست می دهد و احتمالاً Kijun-Sen وارد فاز یک طرفه می شود. اگر هیچ بالاترین یا پایین ترین قیمت جدیدی وجود نداشته باشد و به طور افقی تا حداکثر ۲۶ روز ادامه پیدا کند، فاز یک طرفه نامیده می شود. اگر به طور یکنواخت نزولی و بالاتر از قیمت باشد، روند نزولی خواهیم داشت. تنها اصلاحات کوچک موجب صاف شدن خط نزولی می‌شوند.

تغییر روند

تغییر روند خود را با قطع خطوط Senkou Span ۱ و ۲ نشان می دهد. اگر Senkou Span1 از پایین روبه بالا خط Senkou Span2 را قطع کند، روند صعودی کوتاه مدت خواهیم داشت. بالاترین و پایین ترین قیمت ها در سطح جدیدی که بالاتر است شکل می گیرند. اگر Senkou Span2 همین روال را دنبال کند و صعود کند، تغییر روند ادامه می‌یابد. تغییرات روند معمولاً با ابرهای ضخیم همراه هستند.

سطوح حمایت و مقاومت

هنگامی‌که قیمت بالاتر از ابر است، مرز بالایی ابر نشان دهنده اولین سطح حمایت و مرز پایینی نشان دهنده دومین سطح حمایت است. اگر قیمت پایین تر [از ابر] باشد، مرز پایین ابر اولین سطح مقاومت و مرز بالای ابر دومین سطح مقاومت نامیده می شود. هر چقدر ابر ضخیم تر باشد، منطقه مقاومت و حمایت متراکم تر است.

اگر ابر نازک باشد، قیمت راحت تر از ابر عبور می کند و تغییر روند را تائید می کند. هرچقدر ابر ضخیم تر باشد، منطقه حمایت و مقاومت بزرگ تر است. معمولاً سطوح حمایت و مقاومت از شکست اول دوباره آزمایش می شود.

فراریت (نوسان)

در نتیجه حاشیه های معاملات ابر ضخیم می شود. اگر حاشیه های معاملات روزانه پایین باشد و روند تنها به طور جزئی حرکت کند، در این صورت ابر صعود می کند (یا افت می‌کند) و تنها اندکی حجیم خواهد بود. اگر محدوده معاملات صعودی باشد و اصلاح های قوی وجود داشته باشد در این صورت ابر بیشتر پر خواهد شد و می توانید شاهد افزایش قابل ملاحظه در فراریت باشید.

سیگنال‌های خرید و فروش

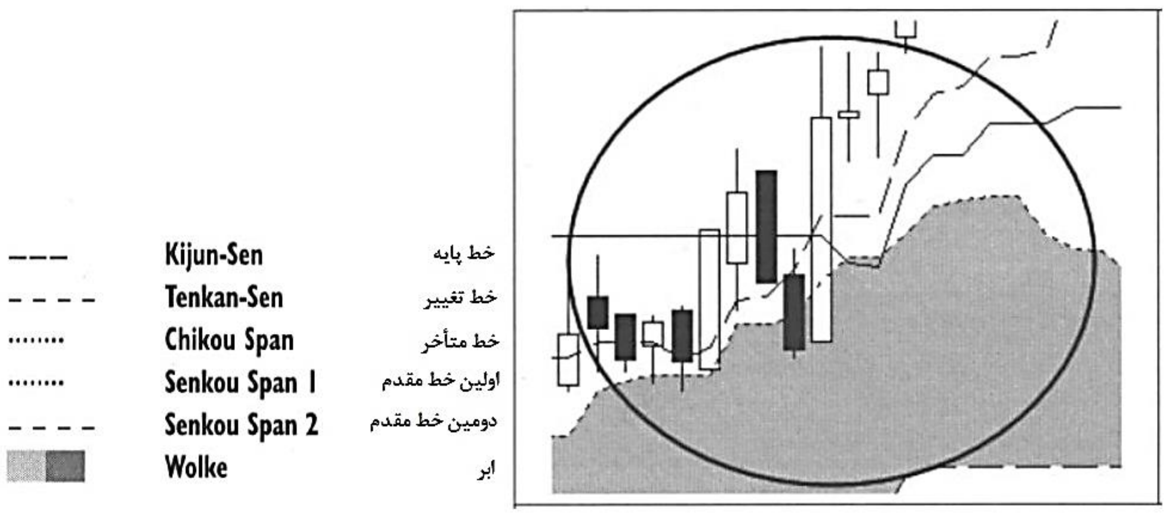
اول از همه، باید دو مورد را درباره فیلتر کردن سیگنال ها در نظر داشته باشید. قیمت یا بالاتر یا درون و یا پایین تر از ابر است. اگر قیمت بالاتر از ابر باشد، تنها اقدامی که می توانید انجام دهید قرار گرفتن در موضع معاملاتی خرید یا بستن مواضع معاملاتی فروش است. اگر قیمت درون ابر باشد، احتمالاً در یکی از لحظات روند یک طرفه قرار دارید و هیچ اقدامی نباید انجام شود. با این حال، اگر قیمت پایین‌تر از ابر باشد، تنها باید موضع معاملاتی فروش اتخاذ کنید و مواضع معاملاتی خرید را ببندید. دوم، خط Chikou Span می تواند بالا، درون یا پایین تر از ابر، و همچنین بالا یا پایین تر از قیمت باشد. اگر خط Chikou Span بالاتر از ابر و بالاتر از قیمت باشد، بازار صعودی (گاوی) است. و اگر پایین تر از هر دو باشد بازار نزولی (خرسی) است.

پنج نوع متفاوت تولید سیگنال وجود دارد. شرحی که در ادامه خواهد آمد باید برای همگی آنها در نظر گرفته شود. سیگنال های خرید بالاتر از ابر قوی تر از سیگنال های تشکیل شده در پایین ابر هستند. سیگنال فروش پایین ابر قوی تر از سیگنال بالاتر از ابر است. سیگنال های تشکیل شده درون ابر خنثی هستند. هنگامی‌که خط Chikou Span ۲۶ روز گذشته، نسبت به شمع های سیگنال، بالاتر و/یا بالاتر از ابر است، سیگنال مثبت خرید شناخته می شود. هنگامی‌که Chikou Span ۲۶ روز گذشته، نسبت به شمع های سیگنال، پایین تر از قیمت و/یا پایین تر از ابر است، سیگنال مثبت فروش شناخته می شود. دو حالت آخر با توجه به سیگنال های مثبت تشدید می شوند و نوع ۱-۴ را ارتقاء می دهند.

گزینه راحت تر برای دنبال کردن سیگنال فروش/خرید این است که توجه کنیم آیا خط CS صرفاً بالاتر/پایین تر از قیمت است.

نوع ۱: قطع خط Kijun-Sen و Tenkan-Sen

هنگامی که DLR [TenkanSen خط تغییر] از قسمت پایین رو به قسمت بالا خط STL [Kijun-Sen خط پایه] را قطع می کند، خرید انجام می دهیم. این حالت از تقاطع خطوط را «کراس طلایی» می نامند. سیگنال قوی هنگامی اتفاق می افتد که تقاطع خطوط بالاتر از ابر رخ می دهد. اگر تقاطع خطوط درون ابر باشد، سیگنال خنثی داریم. اگر تقاطع پایین تر از ابر باشد سیگنال ضعیف است.

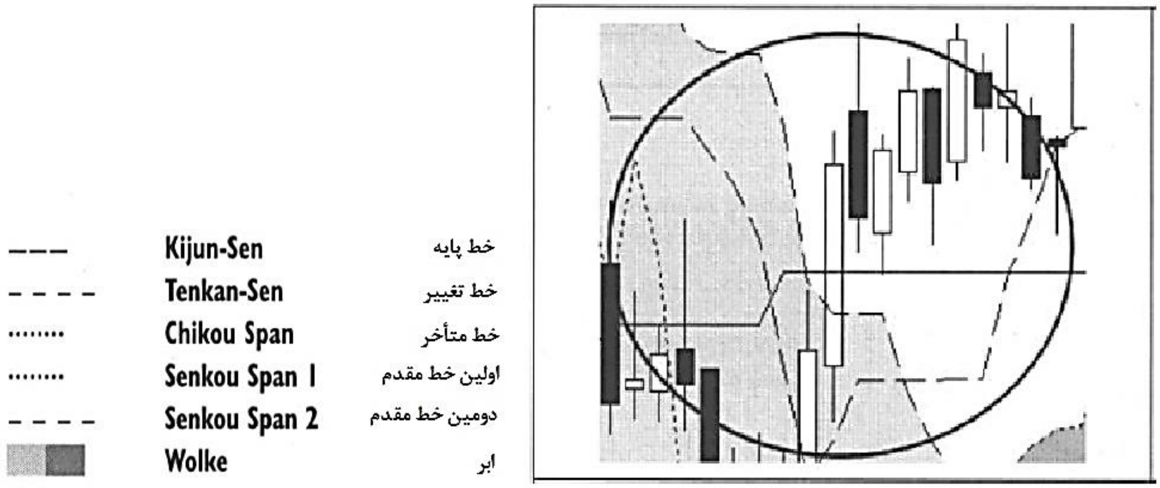


شکل ٤ سیگنال قوی خرید از نوع ۱

سیگنال فروش زمانی ایجاد می شود که DLR از قسمت بالا رو به پایین خط STL را قطع می کند. این نوع تقاطع خطوط «کراس مرگ» نامیده می شود. سیگنال قوی هنگامی اتفاق می افتد که تقاطع پایین تر از ابر باشد. اگر تقاطع درون ابر اتفاق بی افتد سیگنال خنثی است و اگر بالاتر از ابر باشد سیگنال ضعیف است.

نوع ۲: تقاطع خط Kijun-Sen و روند قیمت

هنگامی که خط قیمت، خط STL را از قسمت پایین رو به بالا قطع می کند خرید انجام می دهیم. هنگامی‌که تقاطع [کراس] بالای ابر اتفاق می افتد سیگنال قوی خواهد بود (تصویر ۵). اگر تقاطع درون ابر باشد، سیگنال خنثی خواهد بود. و هنگامی‌که تقاطع زیر ابر باشد سیگنال ضعیف تشخیص داده می شود.

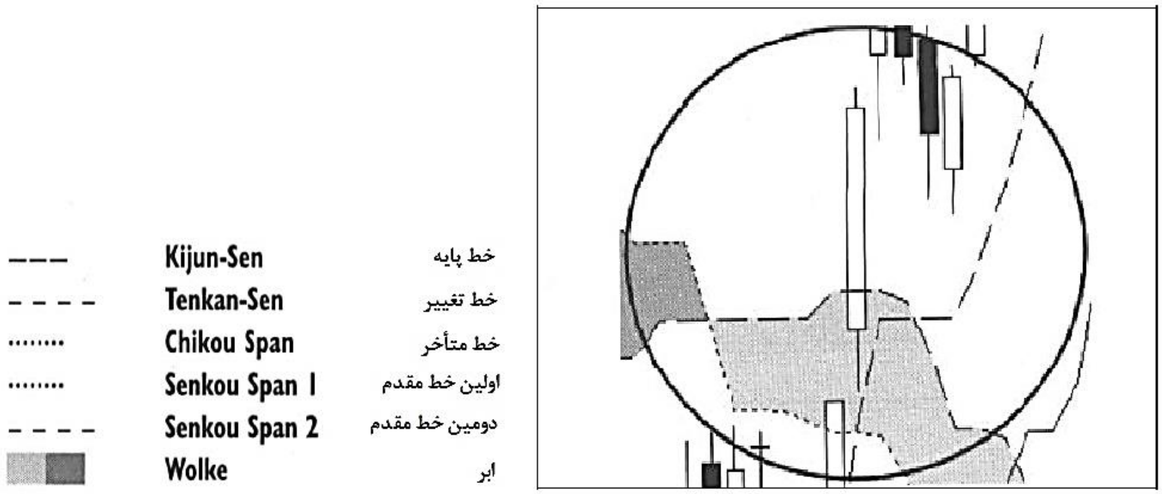


شکل ۵ سیگنال قوی خرید از نوع ۲

هنگامی‌که خط روند قیمت خط STL را از قسمت بالا رو به پایین قطع می کند، فروش انجام می شود. هنگامی‌که تقاطع [کراس] پایین ابر اتفاق می افتد سیگنال قوی خواهد بود (تصویر ۵). اگر تقاطع درون ابر باشد، سیگنال خنثی، و هنگامی‌که تقاطع بالای ابر باشد سیگنال ضعیف خواهد بود.

نوع ۳: شکست روند قیمت از ناحیه ابر

هنگامی‌که خط قیمت ناحیه ابر را از پایین رو به بالا قطع می کند و از خط مرزی بالایی را در پایه قیمت بسته شدن، می شکند ، سیگنال خرید ایجاد می شود.

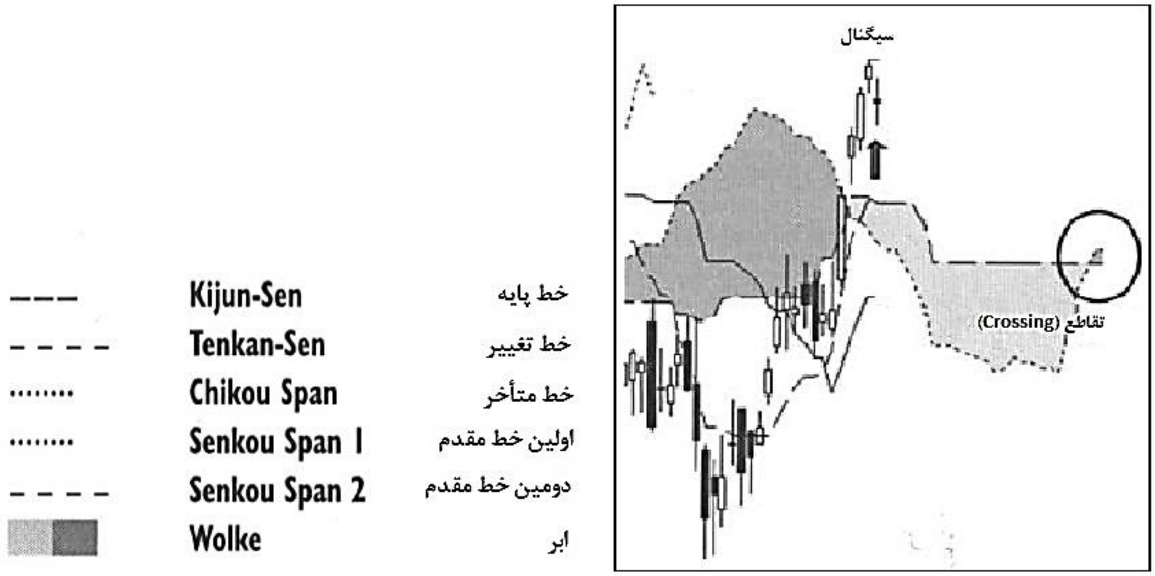


شکل ٦ سیگنال خرید نوع ۳

هنگامی‌که خط قیمت ناحیه ابر را از بالا رو به پایین قطع می‌کند و خط مرزی پایین را در پایه قیمت بسته شدن، می‌شکند ، سیگنال فروش ایجاد می‌شود.

نوع ۴: تقاطع خط Senkou Span 1 و خط Senkou Span 2

هنگامی‌که خط S1 از پایین رو به بالا خط S2 را قطع می‌کند، اقدام به خرید می کنیم. هنگامی که قیمت کنونی بالاتر از ابر باشد، سیگنال قوی خواهد بود (تصویر۷). اگر قیمت کنونی درون ناحیه ابر باشد سیگنال خنثی است، و اگر قیمت کنونی پایین تر از ابر باشد به عنوان سیگنال ضعیف تشخیص داده می شود.

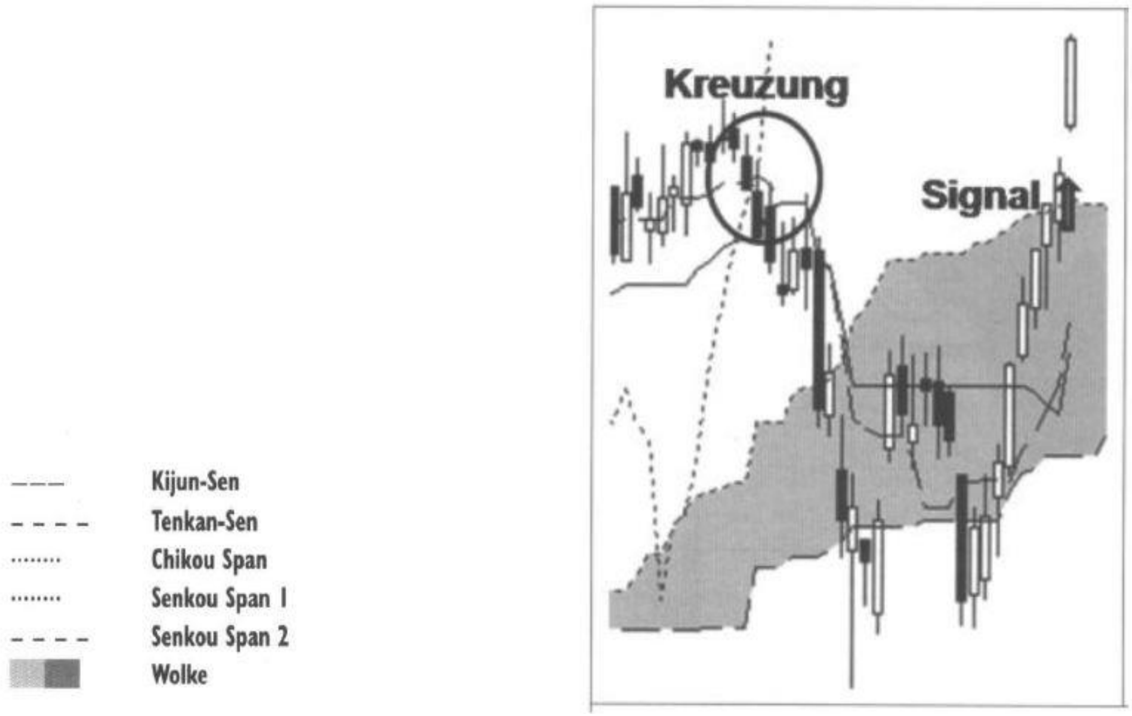


شکل ۷ سیگنال قوی خرید از نوع ٤

فروش هنگامی انجام می شود که خطوط S1 و S2 از بالا رو به پایین یکدیگر را قطع کنند. هنگامی که قیمت پایین ابر باشد سیگنال قوی خواهد بود. اگر قیمت درون ناحیه ابر قرار بگیرد سیگنال خنثی است، و اگر قیمت کنونی بالاتر از ابر باشد به عنوان سیگنال ضعیف در نظر گرفته خواهد شد.

نوع ۵: تقاطع Chikou Span و خط روند قیمت

اگر خط CS خط قیمت را از پایین به سمت بالا قطع کند، سیگنال خرید ایجاد می شود. اگر تقاطع بالای ابر باشد سیگنال قوی خواهد بود (تصویر ۸). هنگامی که دو خط در ابر یکدیگر را قطع کنند سیگنال خنثی و هنگامی‌که زیر ابر تقاطع رخ دهد سیگنال ضعیف خواهد بود.



شکل ۸ سیگنال قوی خرید از نوع ۵

هنگامی که خط CS خط قیمت را از بالا به سمت پایین قطع کند، اقدام به فروش می کنیم. اگر تقاطع زیر ابر باشد سیگنال قوی خواهد بود (تصویر ۸). هنگامی‌که دو خط در ابر یکدیگر را قطع کنند سیگنال خنثی و هنگامی‌که تقاطع بالای ابر رخ دهد سیگنال ضعیف خواهد بود.

به‌طور خلاصه، می توان گفت که با IKH پنج نوع تولید کننده سیگنال و دو گزینه برای فیلتر کردن سیگنال ها وجود دارد. همیشه عاقلانه است که منتظر قیمت بسته شده باشیم تا ببینیم آیا سیگنال هنوز وجود دارد یا خیر. بنابراین احتمال سیگنال کاذب کاهش می یابد.

٤٫٣. نظریه زمان و موج

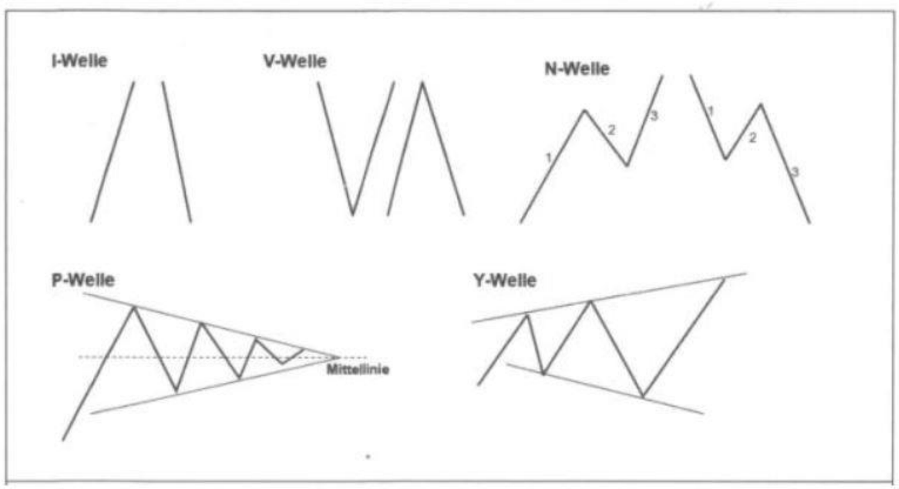
«جوهره بازار در زمان نهفته است و قیمت ها پیامد همین امر است. این بیانیه به توسعه تکنولوژی اندیکاتور منجر شده است.». زمان بخش مهمی از IKH است به همین دلیل استاد [گویچی هوسودا] سال ها به بررسی و مشاهده عدد شناسی شرقی و غربی پرداخت. او دریافت که در سرتاسر کائنات عددهایی که در ادامه اشاره خواهد شد، تغییرات و تولد دوباره را تعیین می کنند: ۹، ۱۷، ۲۶ و عدد ۳ مظهر مشیت الهی است. این نظریه مبتنی بر نظام عددی مقابل است: ۹ واحد پایه است؛ ۱۷ دو واحد پایه است، یکی کسر شده چون شمع آخر و شمع اول واحد بعدی دوباره شمرده نمی‌شود؛ ۲۶ سه واحد پایه است، که از آن نیز یکی کسر شده است. می توانید کل این روال را ادامه بدهید و این سه عدد را کنار یکدیگر بگذارید، طوری که درنهایت به ۲۵۷ خواهید رسید، که به خوبی متناظر با یک سال معاملاتی است (تصویر ۹). بنابراین مشاهده می کنیم که خطوط Kijun-Sen و Tenkan-Sen بر اساس همین اصل بهینه شده اند.

اعداد فراگیر		
۹	واحد پایه (basic unit)	
۱۷	دو واحد پایه	۱-۹+۹
۲۶	سه واحد پایه یا واحد دوره (term unit)	
اعداد مرکب		
۳۳	دو واحد پایه + دو واحد پایه	۱-۱۷+۱۷
۴۲	یک واحد دوره+ دو واحد پایه	۱-۲۶+۱۷
۶۵	واحد فوق العاده بزرگ (super big unit)	۱-۳۳+۳۳
۷۶	یک چرخه (چرخه)	۲-۲۶+۲۶+۲۶
۱۲۹		۱-۶۵+۶۵
۱۷۲		۳-۶۵+۴۲+۴۲+۲۶
۲۵۷		۱-۱۲۹+۱۲۹

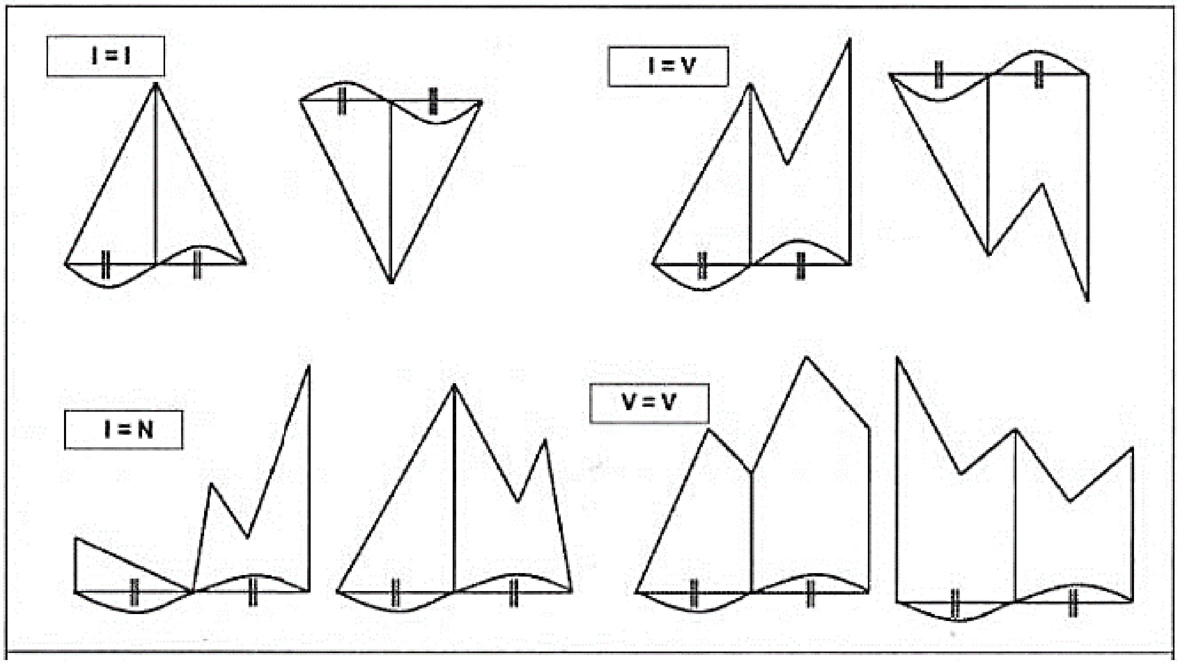
شکل ۹ اعداد فراگیر استاد

درنهایت، می توان گفت با کمک نظریه زمان و اعداد فراگیر استاد می توان بازه زمانی برای نقطه عطف تغییر روند را از قبل تعیین کرد. این بازه زمانی دارای محدوده تقریبی به علاوه/منهای ۱ تا ۲ روز قبل یا بعد از تاریخ روز محاسبه شده است.

با در نظر گرفتن نظریه موج نیز می توان بیانیه دیگری درباره اهمیت بازگشت روند نتیجه گیری کرد، یعنی یا اصلاحات کوچکی در روند حاکم رخ می دهد یا بازگشت روند رخ خواهد داد. نظریه موج شامل سه موج اساسی I، V و N، و همچنین دو موج مثلث P و Y است. نظریه موج بر اساس اصول مقابل است: موج I متناظر با افزایش یا کاهش قیمت ساده است و ترکیب یک موج I افزایش قیمت و یک موج I کاهش قیمت یک موج V ایجاد می‌کند. الگوی پایه موج N است. و موج P با مثلث متقارن متناظر است و به عنوان تشکیل مداومت در نظر گرفته می شود. موج Y یک مثلث متقارن معکوس است که رأس پهن شونده نیز نامیده می شود. این وضعیت یکی از کمیاب ترین شکل گیری هاست که شکل گیری معکوس کننده روند است (تصویر ۱۰).



شکل ۱۰ موجهای پایه و مثلثی



شکل ۱۱ طرح ترکیب نظریه موج و زمان

استاد[۱] این دو نظریه را در کنار یکدیگر قرار داد و هشت ترکیب متفاوت ، چهار روند صعودی، و چهار روند نزولی به دست آورد (تصویر ۱۱). ابتدا، روند صعودی، و سپس روند نزولی معکوس می‌شود. برای موج I=I، یک روند صعودی (موجI) و یک روند نزولی با همان فاصله و همان انبساط یافتگی در طول زمان (موج I) داریم. در گوشه سمت راست بالا ترکیبی از یک موج- I و یک موج- V داریم، که به‌موجب آن انبساط یافتگی زمانی هر دو موج نیز دارای طول برابر است. در گوشه پایین سمت چپ ترکیبی از حرکت نزولی ساده (موجI) با موج N بعدی داریم. در اینجا نیز ، انبساط یافتگی‌های زمانی طول یکسان دارند. و در گوشه سمت راست پایین اتصال دو موج V داریم.

٤ . آزمایش‌ها

در ادامه، استراتژی IKH (IKHS1) در بازارهای مختلف اجرا و تجزیه و تحلیل می شود. پنج نوع سیگنال خرید، و فروش، به همراه ضعیف، خنثی، و قوی را در نظر می گیریم. از حد ضررها (استاپها) و ملاحظات سطوح مقاومت و حمایت صرف نظر شده است. علاوه بر این دو استراتژی اصلاح شده به کار گرفته شده اند. ازیک‌طرف IKH با سیگنال های قوی و خنثی (IKJS2) و از طرف دیگر IKH با سیگنال های قوی خرید و فروش را داریم (IKHS3).

درمجموع بیست و هشت بازار با سه استراتژی بر اساس نمودار روزانه آزمایش می شود. برای هر استراتژی و هر بازار، دو تصویر و چهار کمیت وجود دارد. اولین تصویر بخشی از نمودار است که بازار مربوط به استراتژی اجرا

[۱]- گوئیچی هوسودا

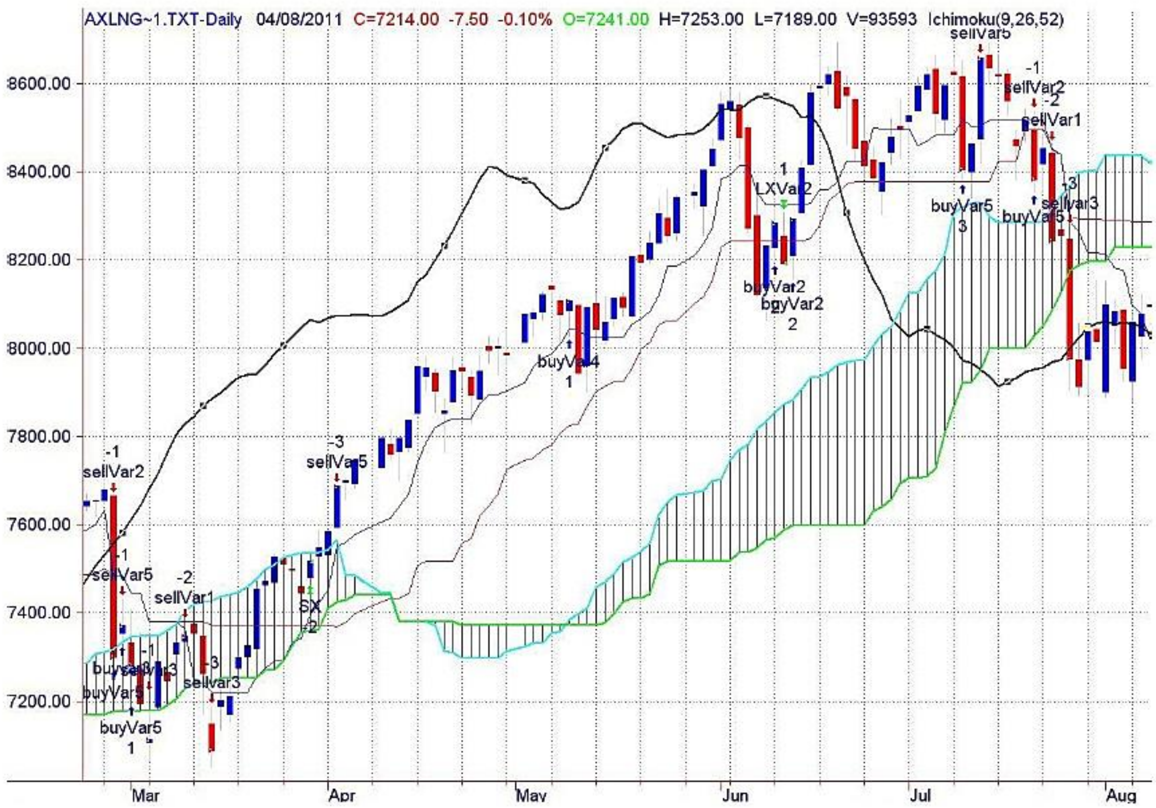
شده را نشان می دهد. در این تصویر می توان پنج اندیکاتور، ابر و تشکیل قیمت را مشاهده کرد. راهنمای نمودار توضیح می دهد که هر یک از اندیکاتورها مربوطه و سایر موارد با چه علامتی نشان داده شده اند. تصویر دوم equity curve (نمودار ارزش یک حساب معاملاتی در یک محدوده زمانی خاص) را در طول تمام دوره داده های موجود نشان می دهد. در حالت بهینه نمودار پیوسته در حال صعود است.

چهار متغیر عبارت اند از تعداد معاملات، نرخ موفقیت (TQ)، میانگین سود و زیان (DGV) و شاخص سودآوری (PF). تعداد معاملات به رقم کل معاملات اشاره دارد. نرخ موفقیت نشان می دهد چه تعداد از معاملات سودآور بوده اند. مقدار مطلوب ۵۰% یا بالاتر است. پارامتر دوم حاصل تقسیم میانگین سود بر میانگین زیان است. این رقم باید از یک بزرگ تر باشد. شاخص سودآوری حاصل تقسیم سود کل بر زیان کل است. این رقم نیز باید از یک بزرگ تر باشد. اگر این رقم یک یا کوچک تر از یک باشد ، به ترتیب زیان برابر یا بزرگ تر از سود خواهد بود، قابل قیاس با میانگین سود به زیان. در حالت بهینه حداقل شاخص سودآوری یا میانگین سود به زیان بزرگ تر یا برابر دو است. سود به میزان قابل توجهی از زیان بزرگ تر است. بازارهایی که نتایج نسبتاً ضعیفی کسب کردند نام برده شده اند و ارزیابی های آنها در قسمت ضمیمه قابل مشاهده است. سه بازار دیگر نیز بر مبنای نمودار هفتگی و ماهانه آزمایش شدند. در اینجا نیز، نتایج نسبتاً ضعیف در قسمت ضمیمه قابل مشاهده است.

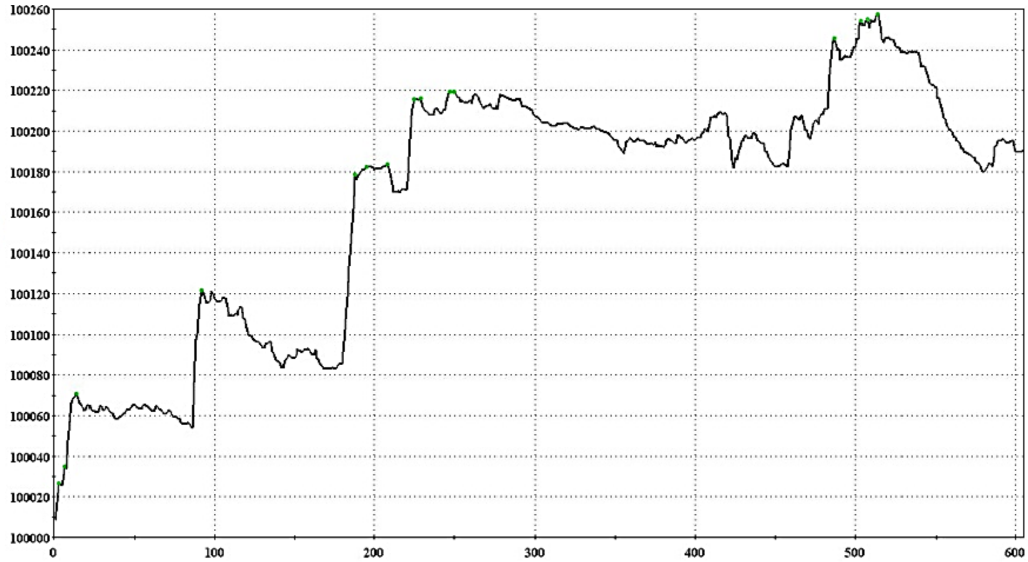
۴٫۱. نمودارهای روزانه آزمایش‌ها

۴٫۱٫۱. IKH نمودارهای روزانه آزمایش‌ها

فیوچرز DAX (AX.LNG)



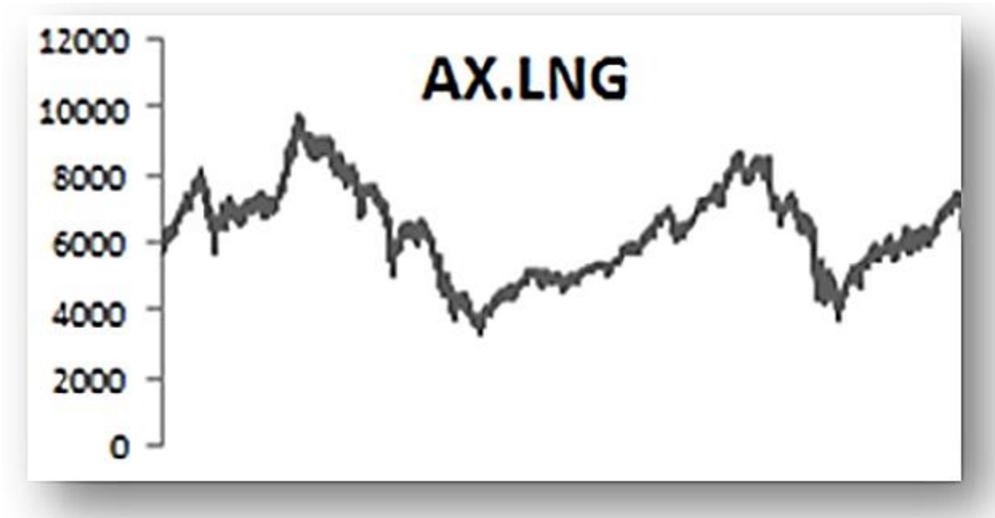
شکل ۱۲ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنالهای قوی، خنثی و ضعیف از مارس تا اوت ۲۰۰۷



شکل ۱۳ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۹۷/۱۱/۰۵ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

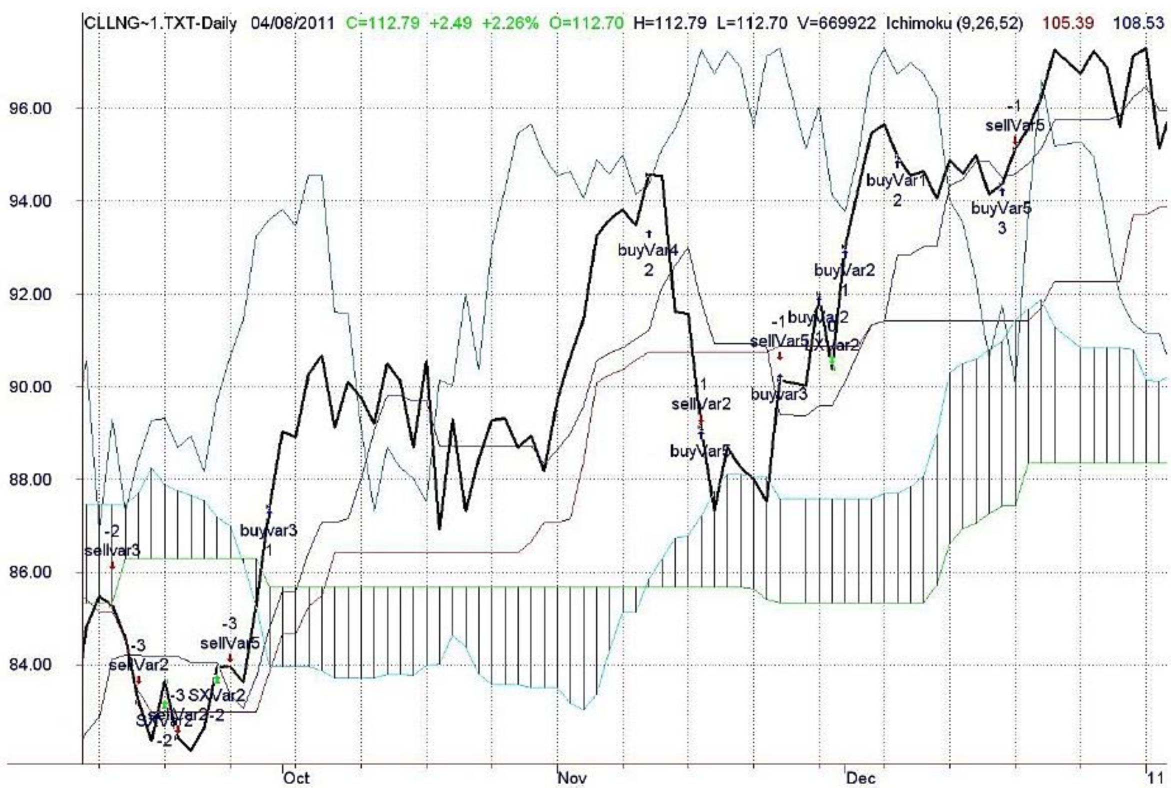
تعداد معاملات	۶۰۵
نرخ موفقیت	%۵۱٫۴۰
میانگی سود و زیان	۱٫۸۶
شاخص سودآوری	۱٫۴۹

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت در جهت بالا و پایین حرکت می‌کند. نرخ موفقیت بالاتر از ۵۰% و میانگین سود و زیان و شاخص سودآوری بزرگ تر از ۱٫۰ است. با این حال هیچ یک بالاتر از ۲٫۰ نیستند.

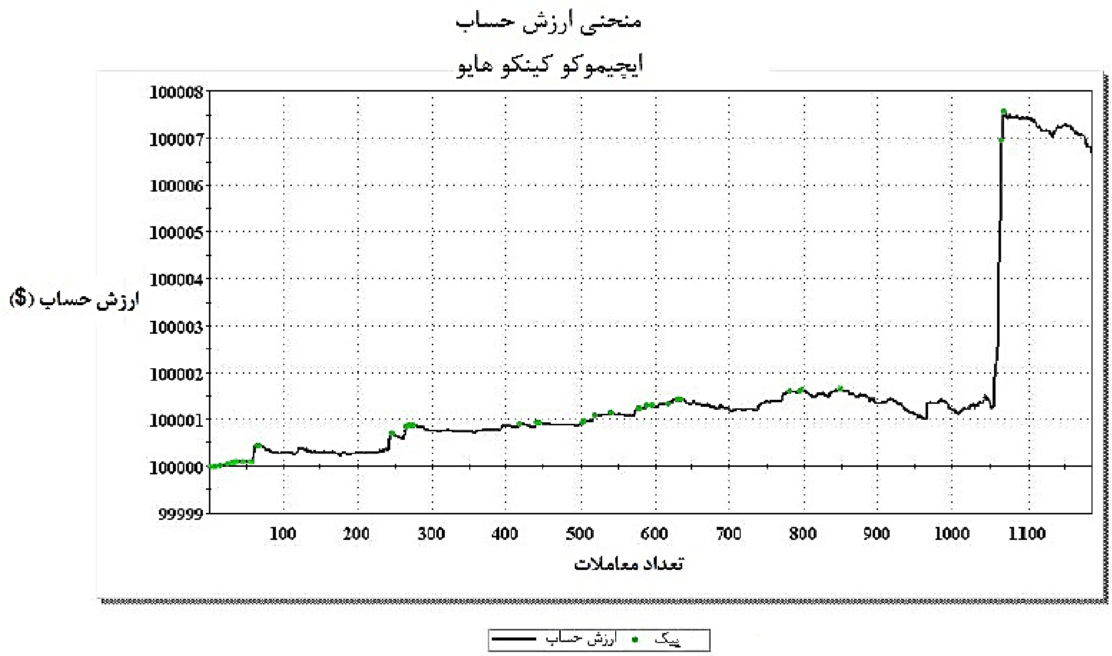


شکل ۱۴ روند قیمت AX.LNG ضعیف از ۱۹۹۷/۱۱/۰۵ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز نفت (CL.LNG)



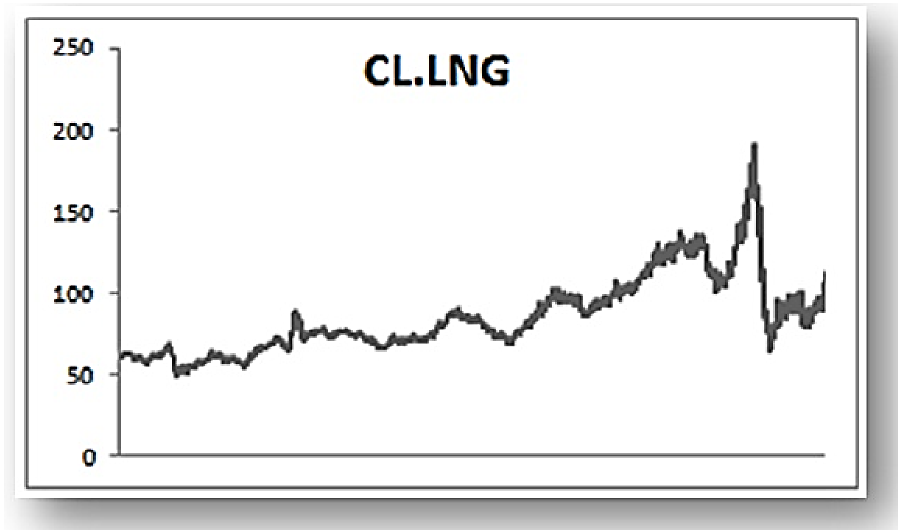
شکل ۱۵ روند قیمت AX.LNG ضعیف از ۱۹۹۷/۱۱/۰۵ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸



شکل Ichimoku Kinko Hyo۱٦ منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

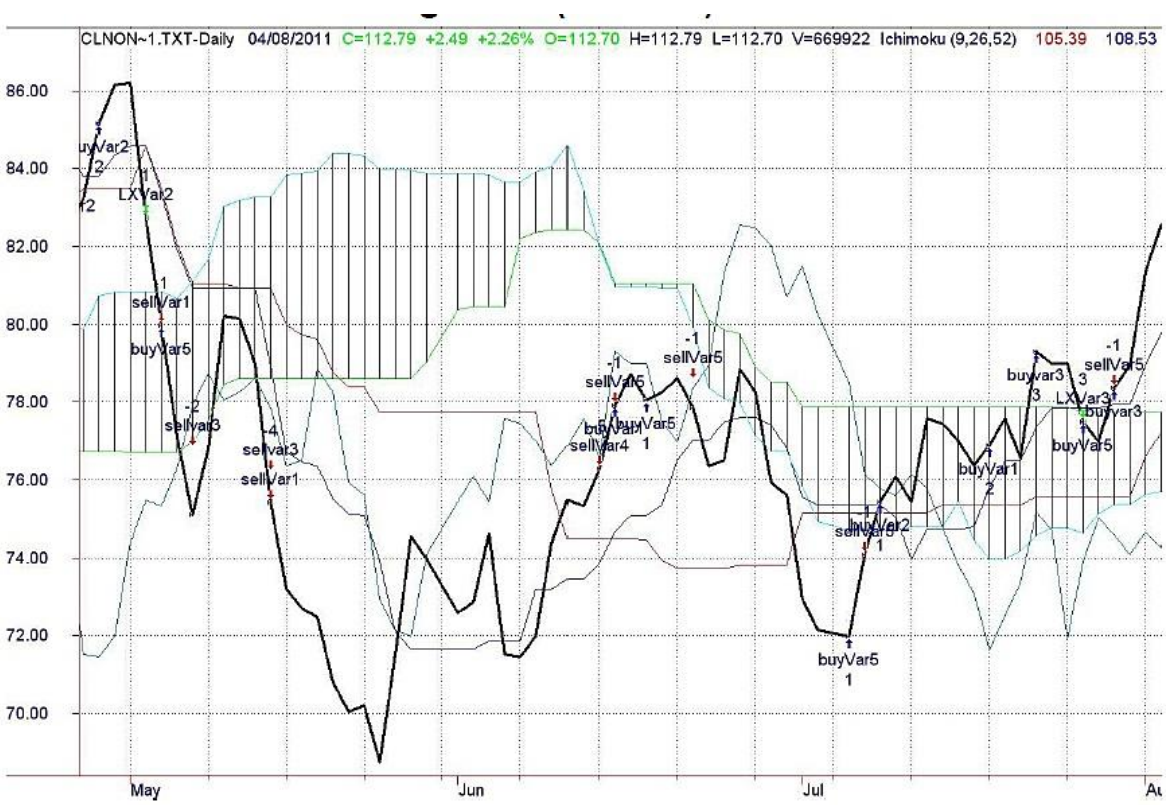
تعداد معاملات	۱۱۸۶
نرخ موفقیت	%۵۲٫۷۸
میانگین سود و زیان	۱٫۸۴
شاخص سودآوری	۲٫۰۵

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت حرکت یک طرفه قوی را نشان می دهد که به دنبال آن افزایش و کاهش های کوچک اتفاق می افتد. نرخ موفقیت بالاتر از %۵۰ و میانگین سود و زیان DGV به میزان قابل توجهی بالاتر از ۱٫۰ است و شاخص سودآوری PF بزرگ تر از ۲٫۰ است. IKHS1 می تواند استراتژی خوبی برای CL.LNG باشد.

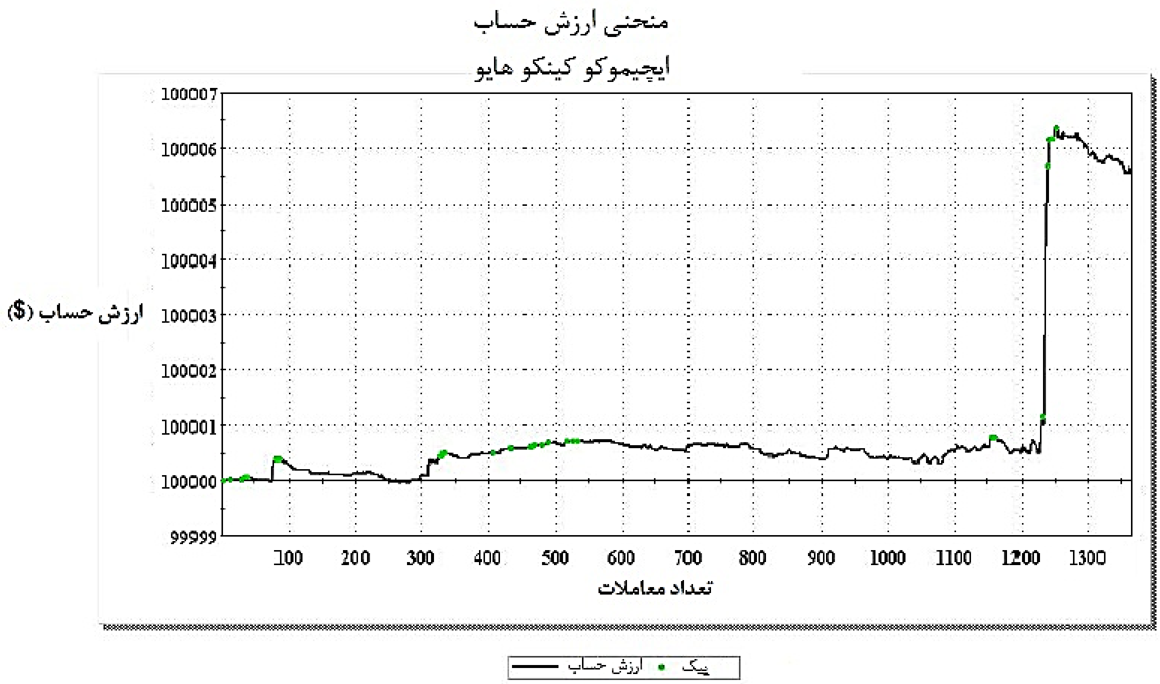


شکل ۱۷ روند قیمت CL.LNG از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز نفت (CL.NON)



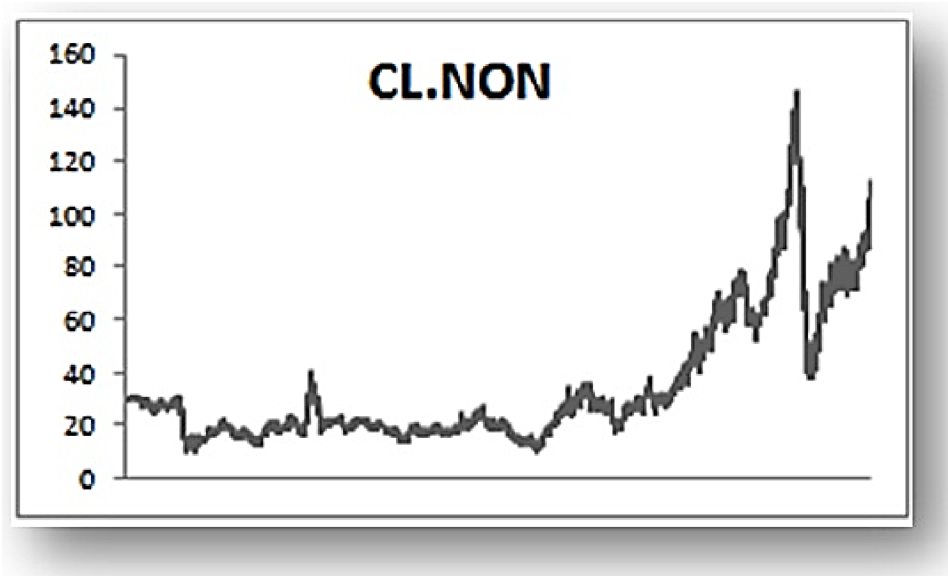
شکل ۱۸ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی و ضعیف از می ۲۰۱۰ تا اوت



شکل ۱۹ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۳۶۵
نرخ موفقیت	%۵۳٫۵۵
میانگین سود و زیان	۱٫۵۷
شاخص سودآوری	۱٫۸۲

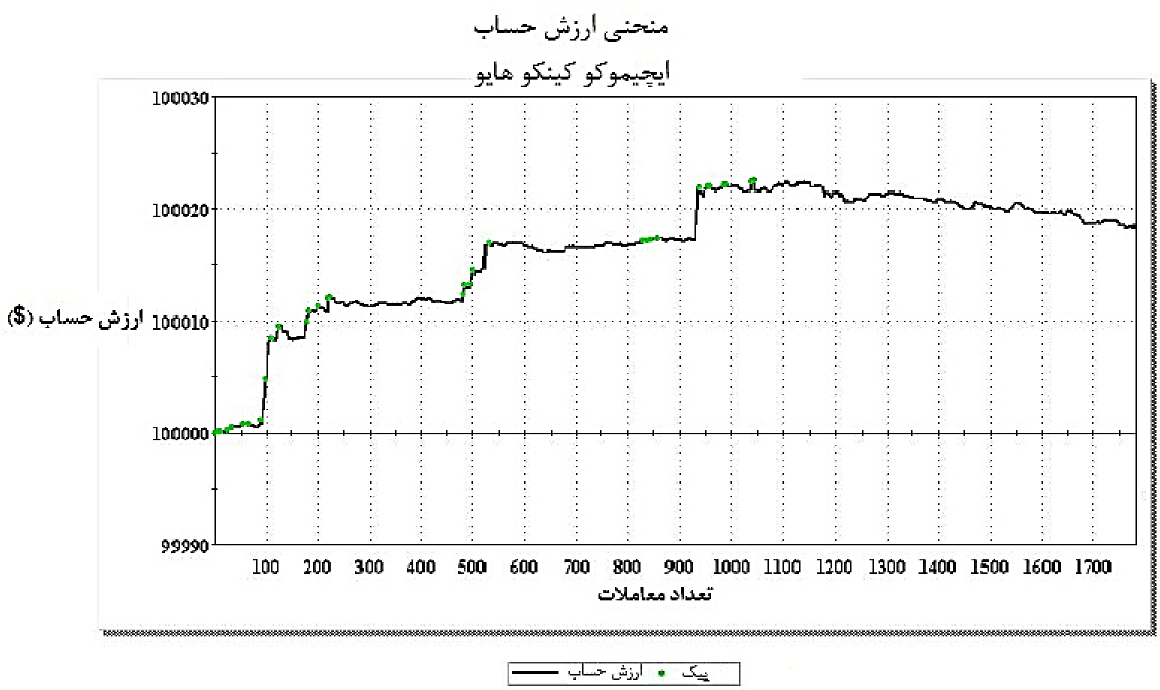
منحنی ارزش حساب به طور پیوسته صعود نمی کند. قیمت حرکت قوی رو به بالا دارد و در ادامه حرکت های بعدی رو به بالا و رو به پایین را نشان می دهد. نرخ موفقیت بالاتر از %۵۰ و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. هیچ یک بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.



شکل ۲۰ روند قیمت CL.NON از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸



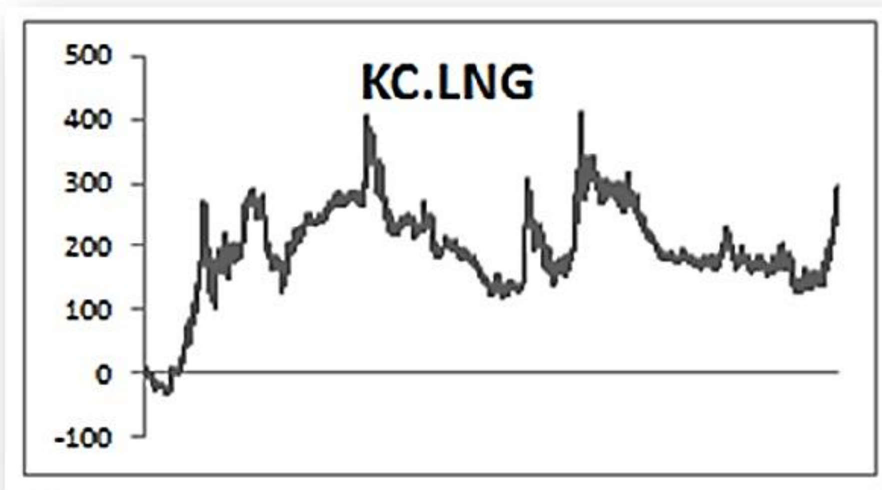
شکل ۲۱ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی و ضعیف از سپتامبر ۲۰۰۹ تا فوریه ۲۰۱۰



شکل ۲۲ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۷۸۲
نرخ موفقیت	%۵۳٫۲۰
میانگی سود و زیان	۱٫۳۹
شاخص سودآوری	۱٫۵۸

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. در روند قیمت حرکت های بالا و پایین تکراری مشاهده می شود. نرخ موفقیت بالاتر از ۵۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. هیچ یک بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.



شکل ۲۳ روند قیمت KC.LNG از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

جدول مقابل مجموع بیست و هشت بازار با نتایج متناظر را فهرست کرده است. فیوچرز نفت نتایج خوبی نشان داد. نتایج سه مورد از بیست و هشت بازار به ارقام مطلوب نزدیک بود. با نگاهی به دیگر بازارها، به‌طور واضح مشاهده می شود که IKHS1 نباید مطابق نسخه اصلی آن به کار گرفته شود.

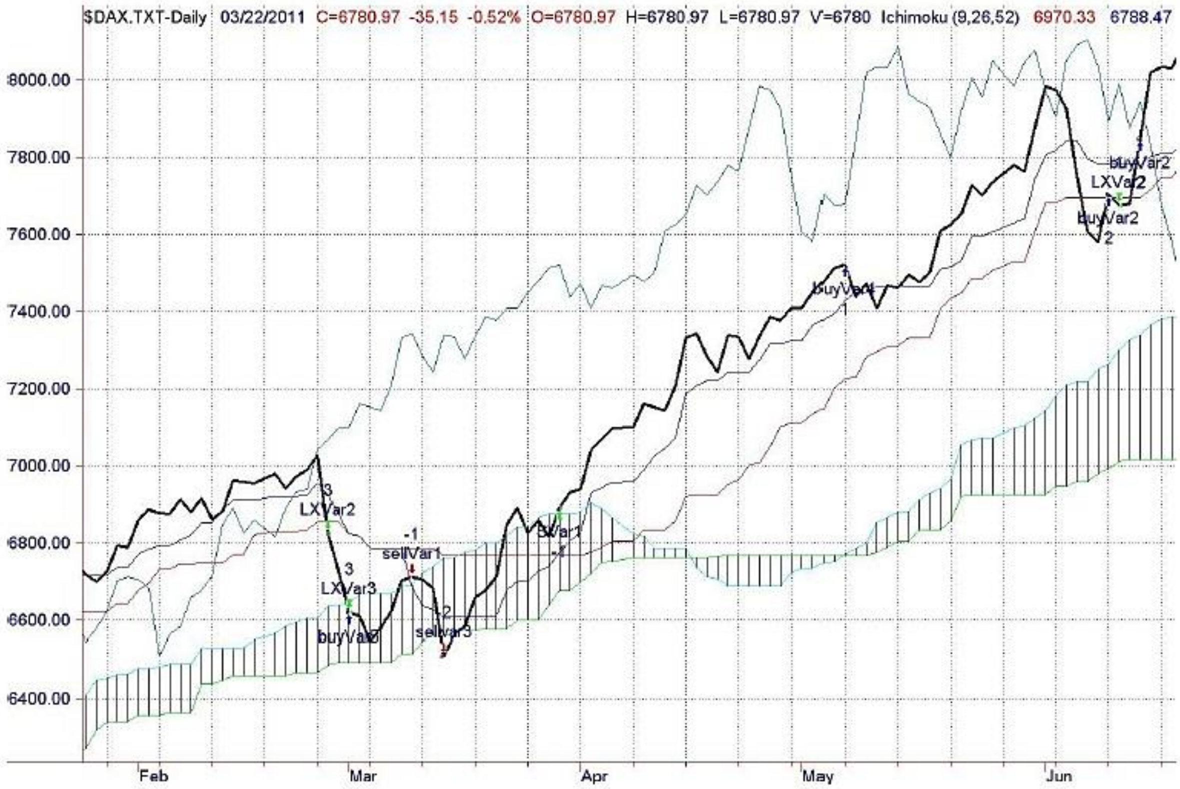
داده‌ها	تعداد معاملات	نرخ موفقیت	میانگین سود و زیان	شاخص سودآوری
Coffee$	۱۴۵۸	۵۶٫۲۴	۰٫۹۲	۱٫۱۸
Cotton$	۱۹۶۵	۵۲٫۰۱	۱٫۱۲	۱٫۲۱
DAX$	۷۷۵	۵۲٫۳۹	۱٫۱۶	۱٫۲۸
Gold$	۱۹۸۳	۵۱٫۲۴	۰٫۸۶	۰٫۹
Silver$	۲۲۰۴	۵۰٫۰۹	۱٫۲۵	۱٫۲۵
SPX$	۳۶۳۱	۵۰٫۲۳	۰٫۹	۰٫۹۱
Wheat$	۱۹۱۳	۴۸٫۵۱	۰٫۸۲	۰٫۷۸
WTCRUDE$	۱۴۷۹	۵۱٫۹۹	۰٫۹۹	۱٫۰۸
AX.LNG	۶۰۵	۵۱٫۴	۱٫۸۶	۱٫۴۹
AX.NON	۵۷۶	۵۱٫۹۵	۱٫۲۶	۱٫۳۶
CL.LNG	۱۱۸۶	۵۲٫۷۸	۱٫۸۴	۲٫۰۵
CL.NON	۱۳۶۵	۵۳٫۵۵	۱٫۵۷	۱٫۸۲
CR.LNG	۱۴۲۱	۴۸٫۵۶	۱٫۲۷	۱٫۲
CT.NON	۱۸۷۴	۵۰٫۱۱	۱٫۲	۱٫۲

داده‌ها	تعداد معاملات	نرخ موفقیت	میانگین سود و زیان	شاخص سودآوری
EURUSD	۵۹۱	۵۸٫۵۴	۰٫۷۴	۱٫۰۴
FX.LNG	۱۵۳۸	۵۱٫۸۹	۰٫۹۲	۰٫۹۹
FX.NON	۱۶۸۲	۶۴٫۱۵	۰٫۶۸	۱٫۲۱
GC.LNG	۱۷۱۳	۵۲٫۱۳	۰٫۹۴	۱٫۰۳
GC.NON	۱۸۴۸	۵۲٫۸۷	۰٫۸	۰٫۹
INDU	۴۱۸۶	۵۰٫۷۹	۱	۱٫۰۳
JN.NON	۱۰۹۱	۵۰٫۶	۱٫۱۱	۱٫۱۴
KC.LNG	۱۷۸۲	۵۳٫۲	۱٫۳۹	۱٫۵۸
KC.NON	۱۹۵۳	۴۸٫۲۸	۱٫۴۳	۱٫۳۳
SI.LNG	۱۹۸۳	۴۸٫۶۶	۱٫۱۸	۱٫۱۲
SI.NON	۲۱۵۴	۴۹٫۴۴	۱٫۱۴	۱٫۱۲
USDJPY	۶۹۷	۵۳٫۹۵	۰٫۹۷	۱٫۱۳
W_.LNG	۲۰۲۶	۵۲٫۸۶	۰٫۹۹	۱٫۱۲
W_.NON	۲۱۶۸	۵۳٫۲۳	۰٫۸۴	۰٫۹۶

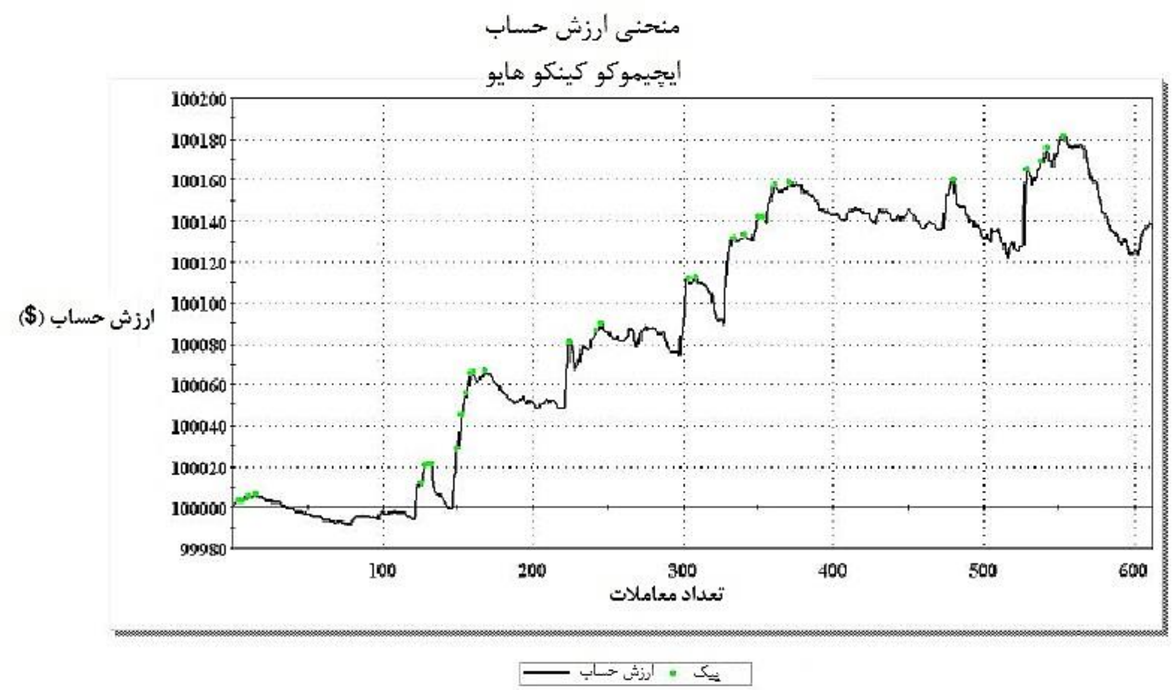
جدول ۱ ۲۸ بازار و IKHS1

٤٫١٫٢ IKH با سیگنال‌های قوی و خنثی

($DAX) DAX



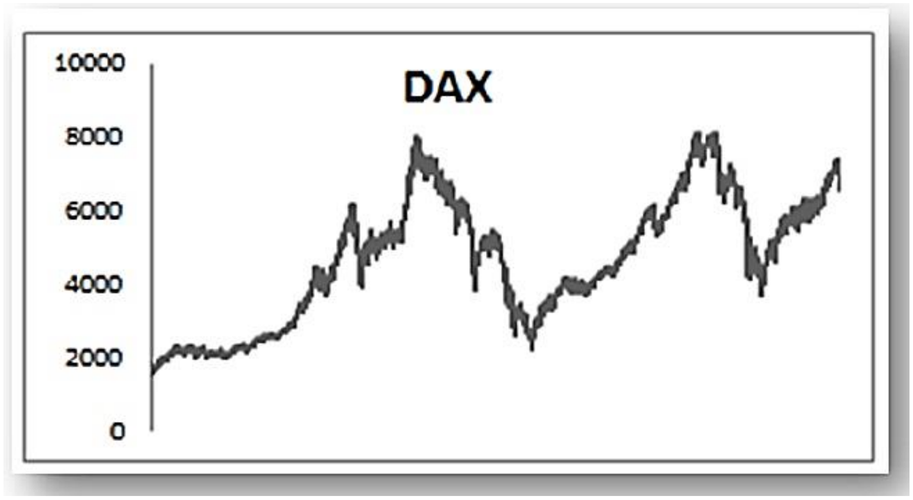
شکل ۲٤ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از می ۲۰۰۹ تا سپتامبر ۲۰۰۹



شکل ۲۵ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۹۲/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲۲

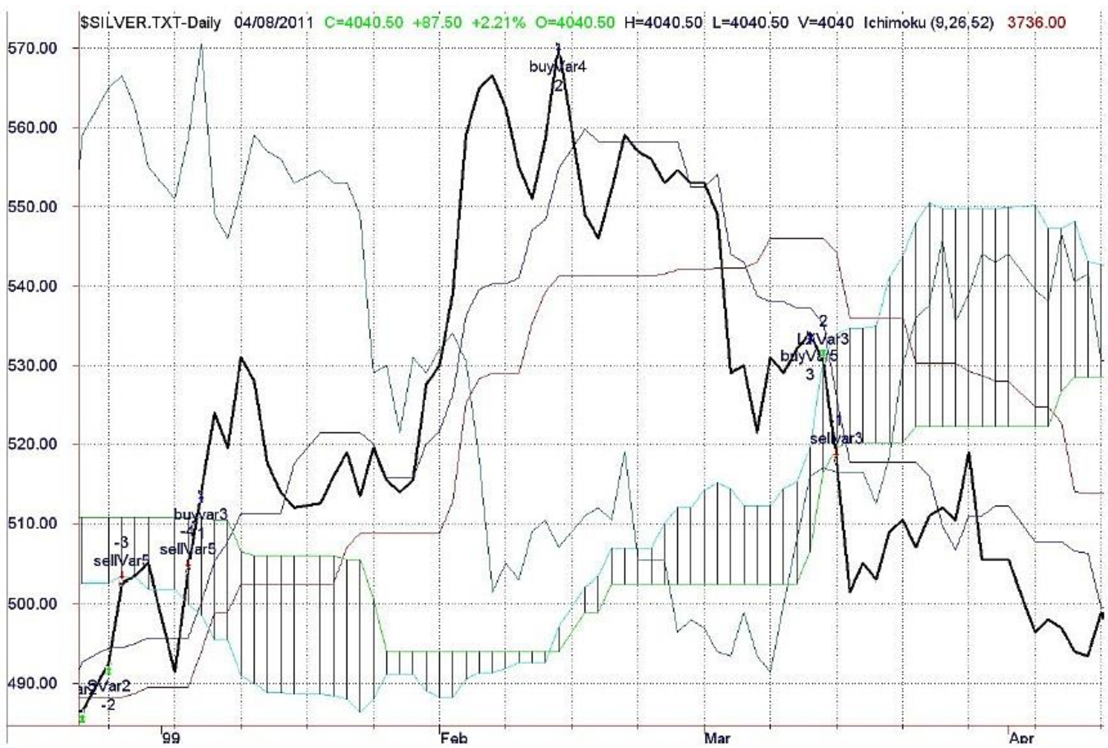
تعداد معاملات	۶۳۱
نرخ موفقیت	%۴۴٫۸۶
میانگی سود و زیان	۱٫۶۵
شاخص سودآوری	۱٫۳۵

منحنی ارزش حساب باید به طور پیوسته در حال صعود باشد. در روند قیمت حرکت های رو به بالا و رو به پایین تکراری مشاهده می شود. نرخ موفقیت تقریباً ۴۵% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. هیچ یک بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.

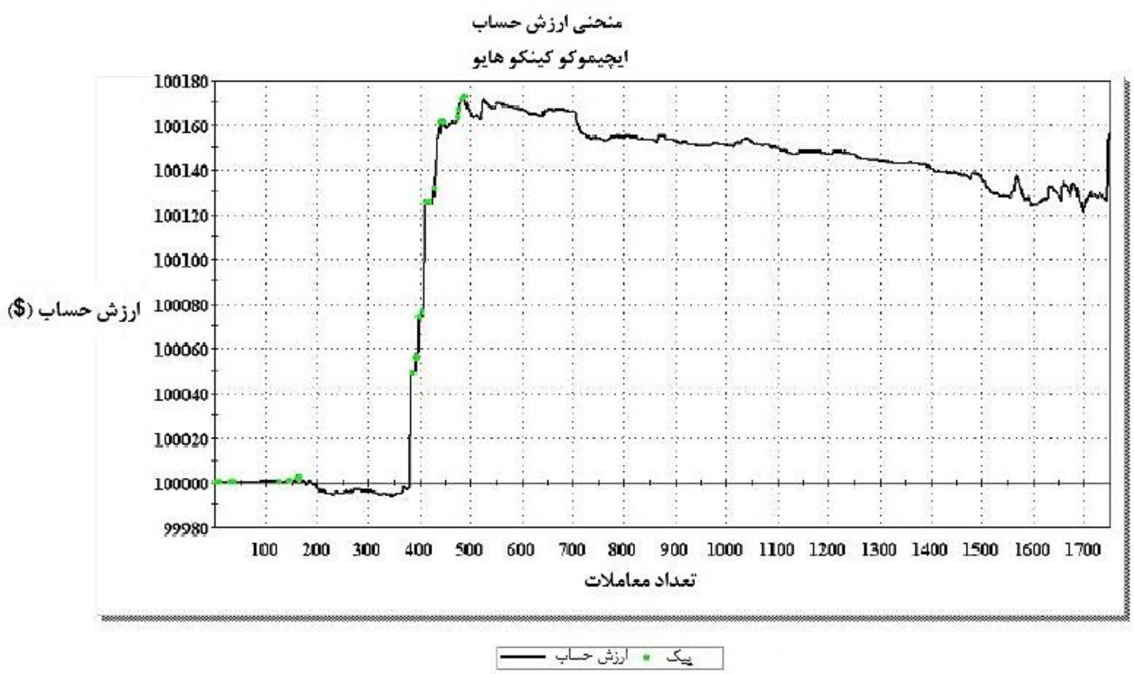


شکل ۲۶ روند قیمت DAX از ۱۹۹۲/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲۲

($Silver) Silver



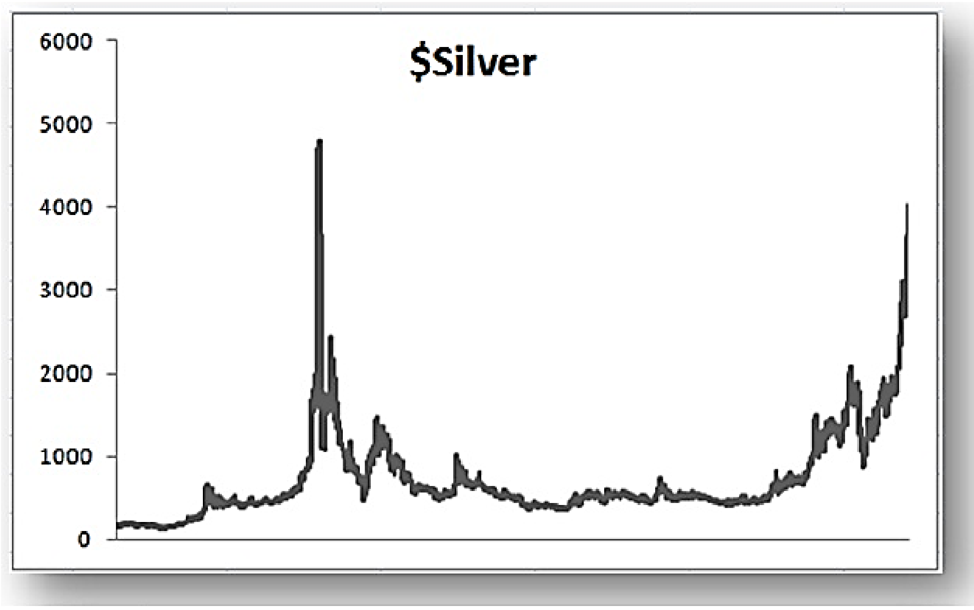
شکل ۲۷ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از ژانویه ۱۹۹۹ تا آوریل ۱۹۹۹



شکل ۲۸ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۶۹/۰۶/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۷۱۵
نرخ موفقیت	%۴۳٫۱۲
میانگی سود و زیان	۲٫۳۵
شاخص سودآوری	۱٫۷۸

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت دو صعود قوی با حرکات یک طرفه بین این دو صعود نشان می دهد. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. PF نیز از ۲٫۰ بزرگ تر است، که IKH2 را به استراتژی بالقوه برای قیمت نقره تبدیل می کند.

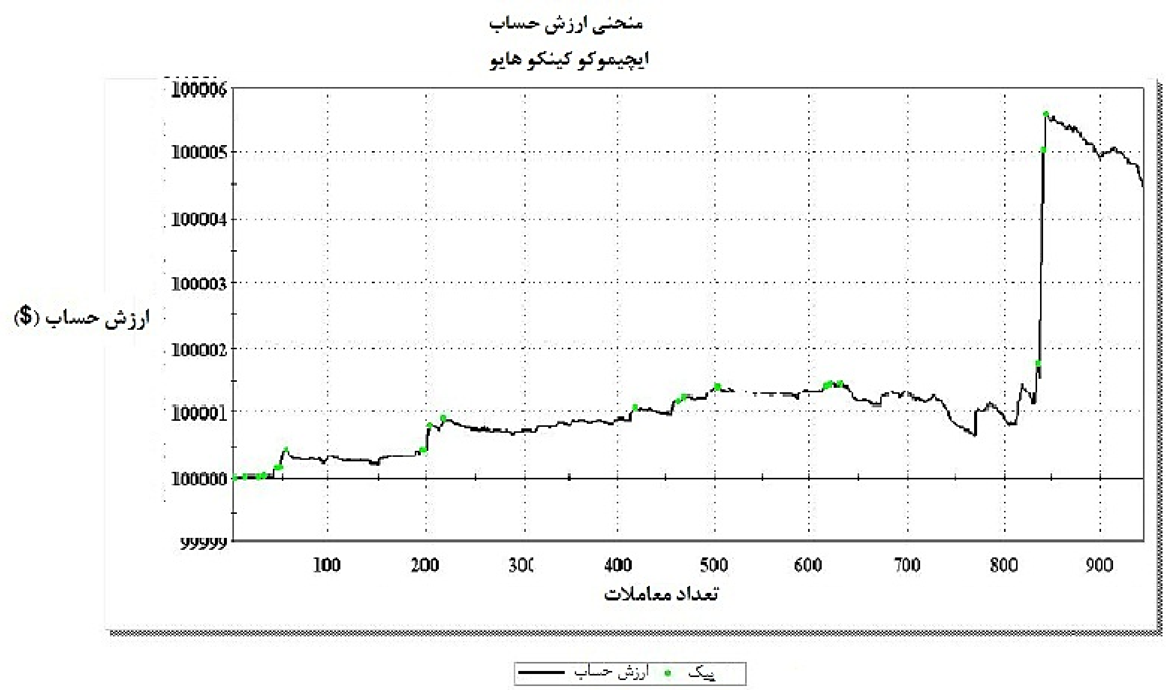


شکل ۲۹ روند قیمت DAX از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز نفت (CL.LNG)



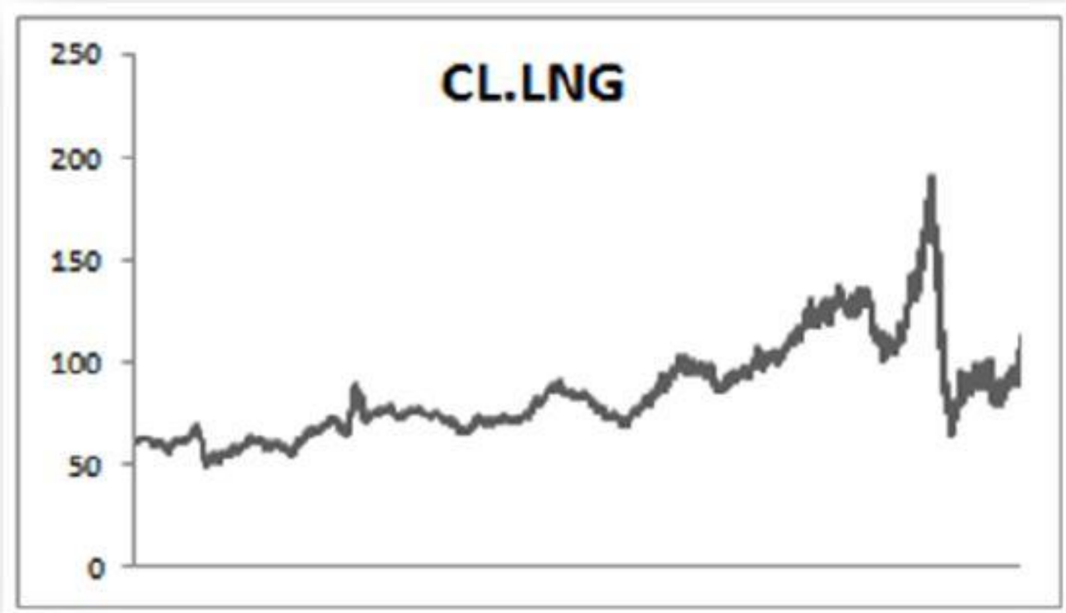
شکل ۳۰ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از دسامبر ۲۰۰۹ تا مارس ۲۰۱۰



شکل ۳۱ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

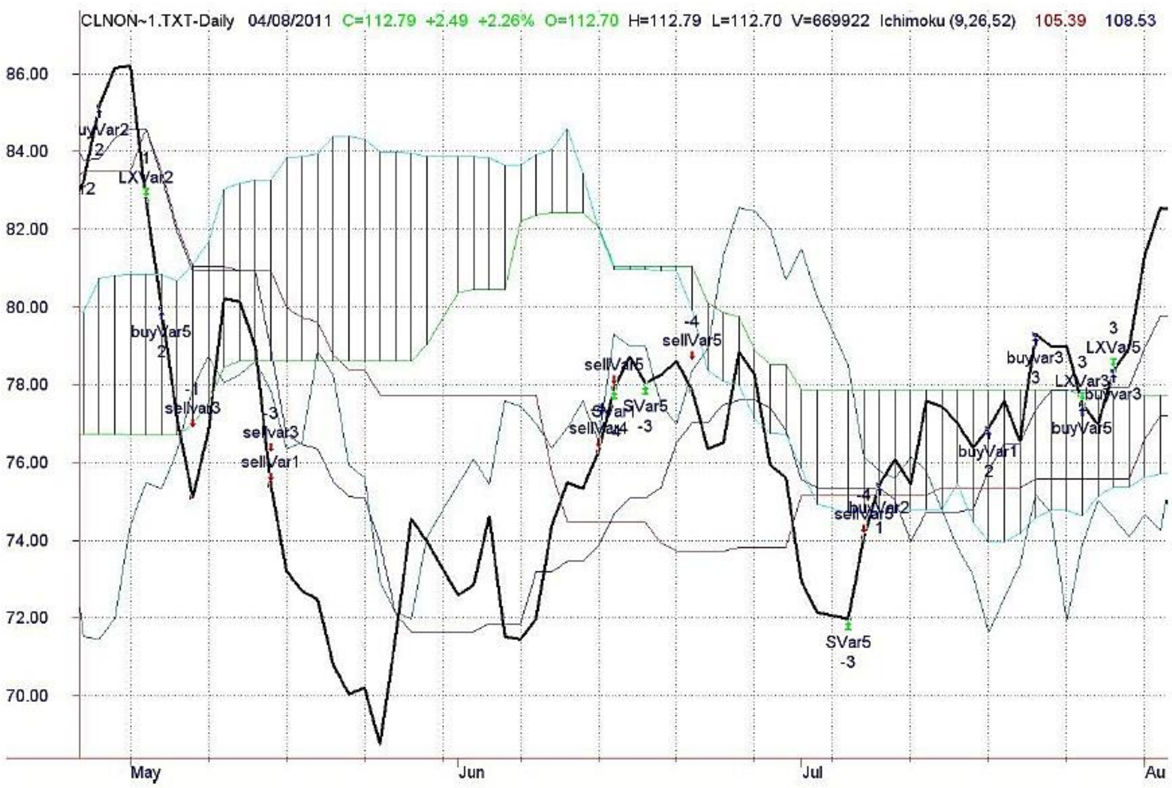
تعداد معاملات	۹۴۴
نرخ موفقیت	%۴۶/۴۰
میانگین سود و زیان	۱/۹۶
شاخص سودآوری	۱/۷۰

در اینجا نیز منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت در ابتدا مسطح است با حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی. از وسط نمودار تا انتها حرکت صعودی و سپس افت شدید مشاهده می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۵% و DGV و PF به میزان قابل توجهی بزرگ تر از ۱/۰ است. و هیچ کدام بزرگ تر از ۲/۰ نیستند.

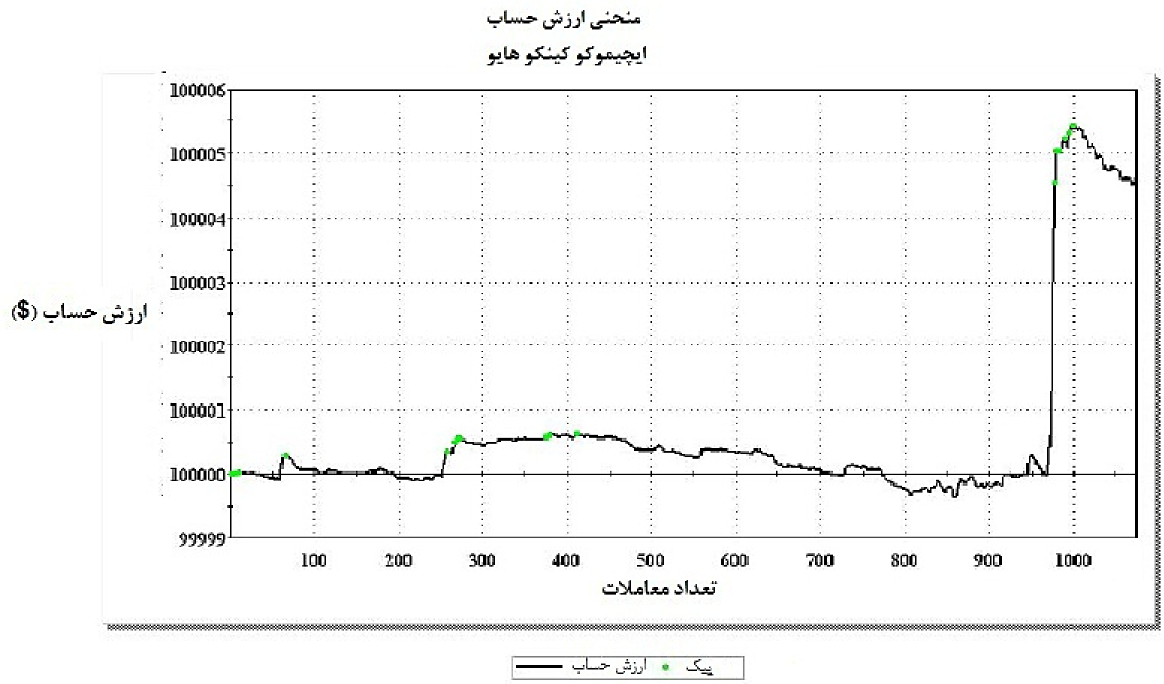


تصویر ۱۷: روند قیمت CL.LNG از ۱۹۸۴/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز نفت (CL.NON)



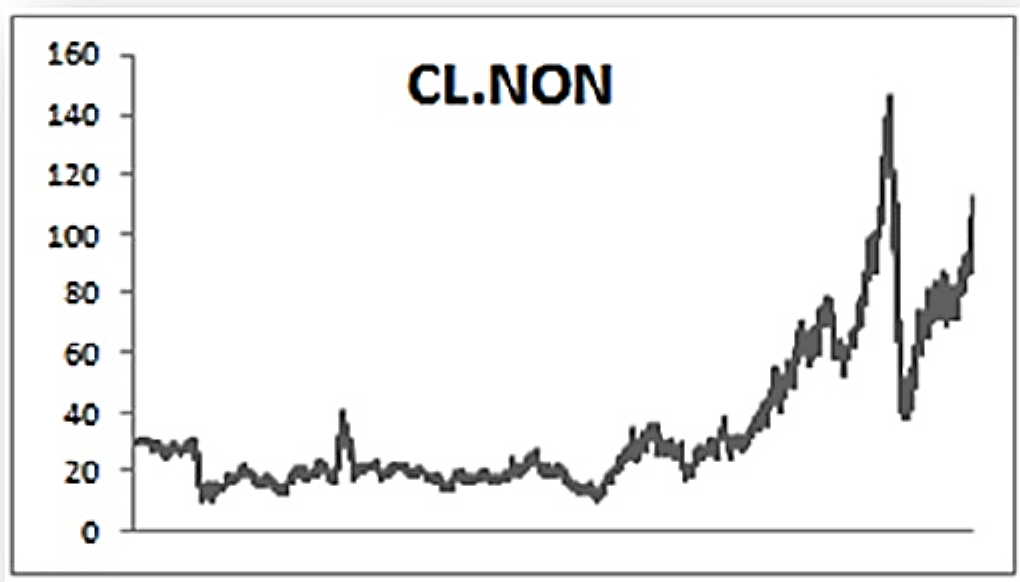
شکل ۳۲ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از می تا اوت ۲۰۱۰



شکل ۳۳ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۰۷۵
نرخ موفقیت	%۴۵٫۲۱
میانگی سود و زیان	۲٫۰۴
شاخص سودآوری	۱٫۶۸

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت در جهت های یک طرفه حرکت می کند با حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی. در انتها صعود قیمت و به دنبال آن افت شدید و سپس صعود مشاهده می شود. نرخ موفقیت تقریباً ۴۵% و DGV و PF به میزان قابل توجهی بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است، که IKH2 را به استراتژی بسیار مطلوبی برای CL.NON تبدیل می کند.



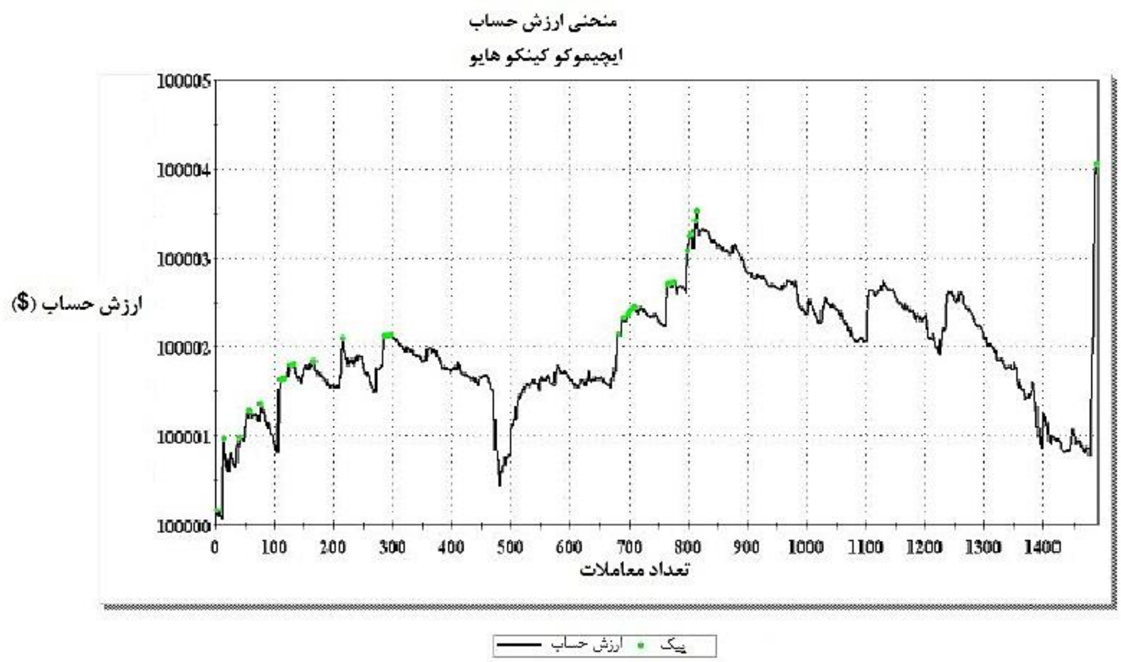
تصویر ۲۰: روند قیمت CL.LNG از ۱۹۸۴/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز پنبه (CT.NON)



شکل ٣٤ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از سپتامبر ۲۰۱۰ تا فوریه ۲۰۱۱

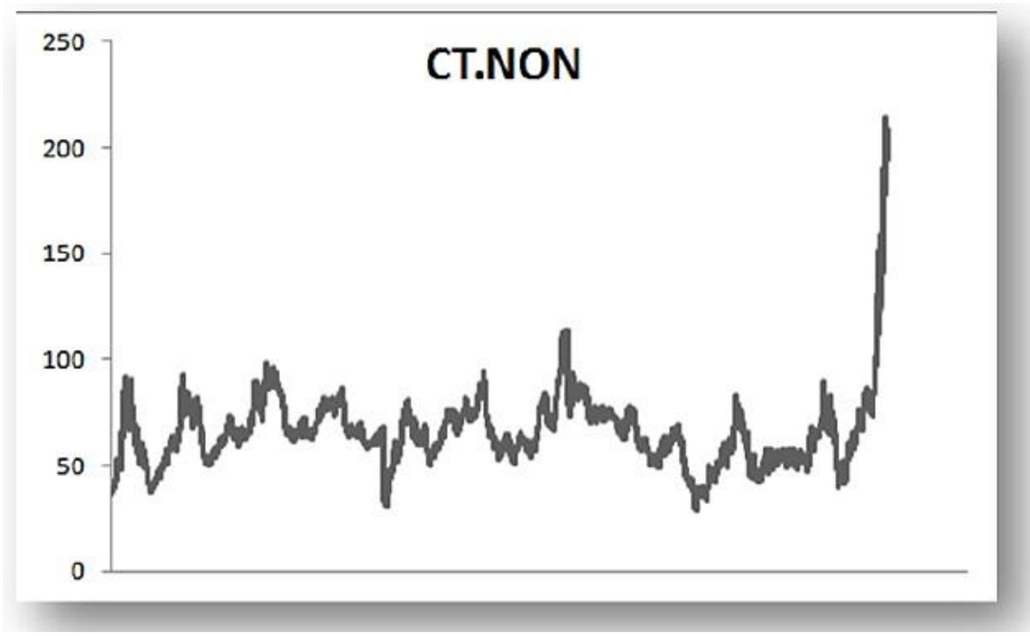
فوریه ۲۰۱۱



شکل ۳۵ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

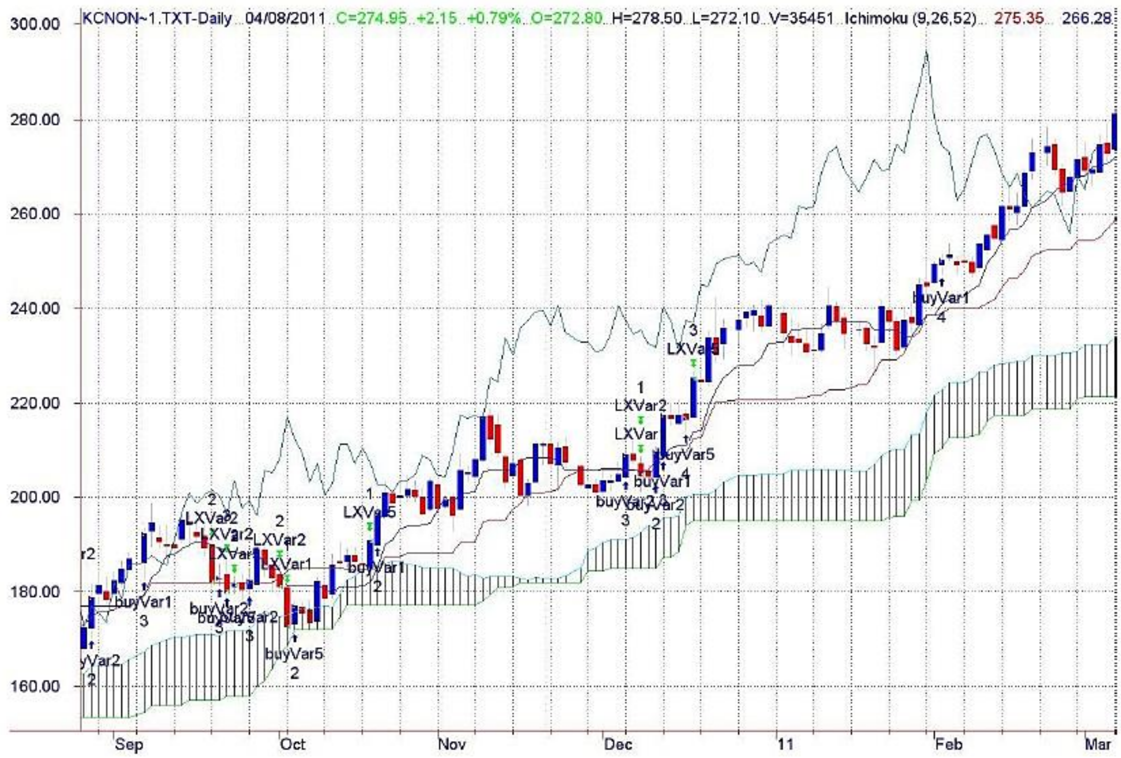
تعداد معاملات	۱۴۸۹
نرخ موفقیت	%۴۲٫۷۱
میانگی سود و زیان	۱٫۴۹
شاخص سودآوری	۱٫۱۱

در منحنی ارزش حساب حرکات روبه بالا و روبه پایین مشاهده می شود، اما هیچ گونه صعود پیوسته وجود ندارد. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی مشاهده می شود. در انتها صعود قیمت قوی مشاهده می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است و هیچ کدام بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.

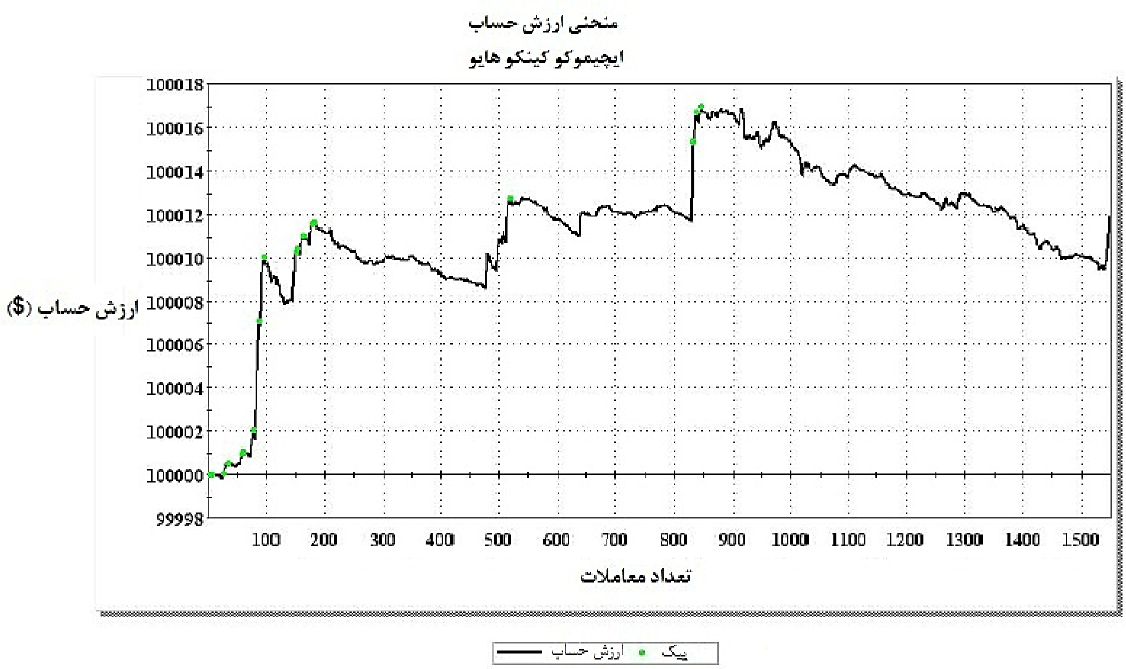


شکل ۳۶ روند قیمت CT.NON از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز قهوه (KC.NON)



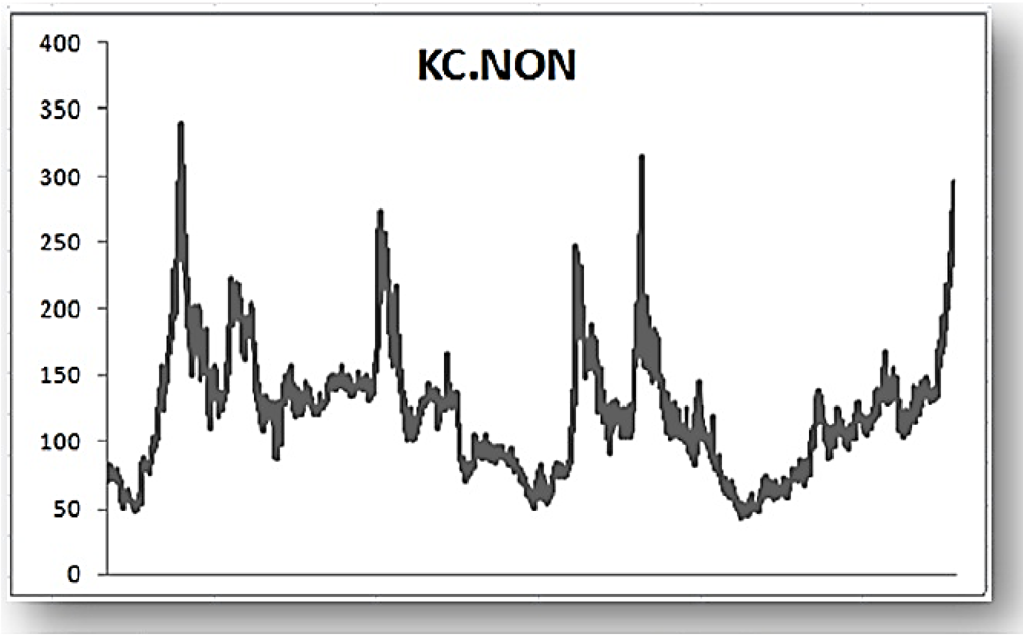
شکل ۳۷ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از سپتامبر ۲۰۱۰ تا مارس ۲۰۱۱



شکل ۳۸ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

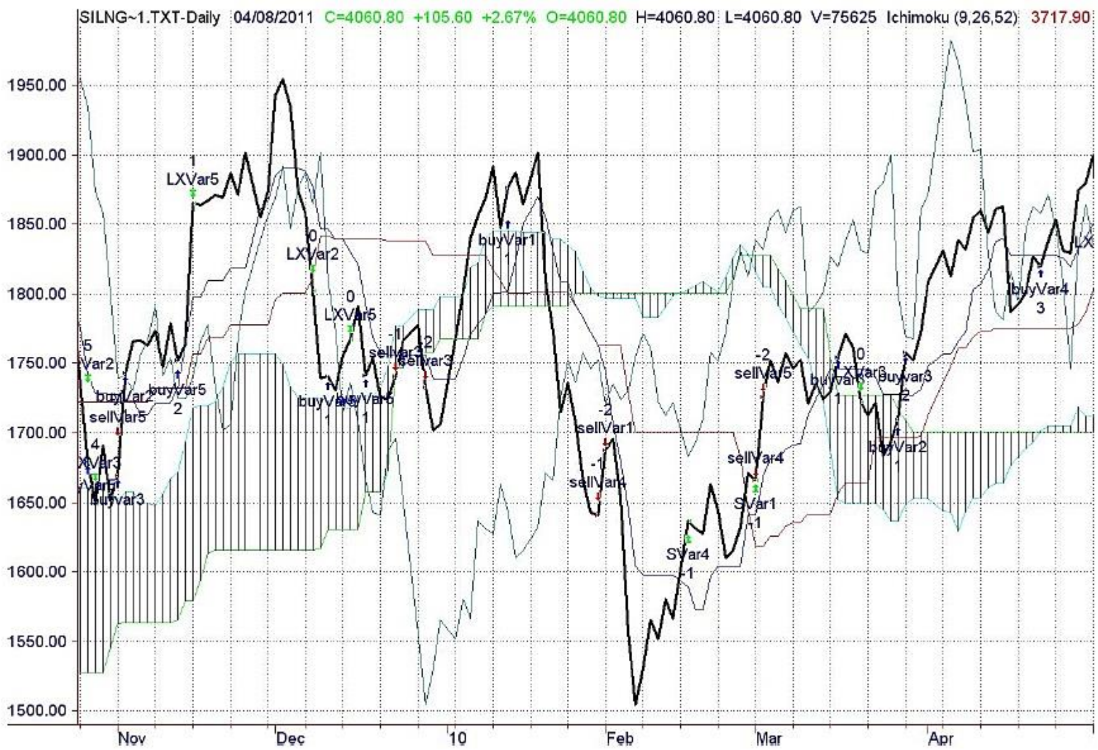
تعداد معاملات	۱۵۵۰
نرخ موفقیت	%۴۲٫۱۳
میانگی سود و زیان	۱٫۷۶
شاخص سودآوری	۱٫۲۸

در منحنی ارزش حساب حرکات روبه بالا و رو به پایین مشاهده می شود، اما هیچ گونه صعود پیوسته وجود ندارد. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین قوی مشاهده می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است و هیچ کدام بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.

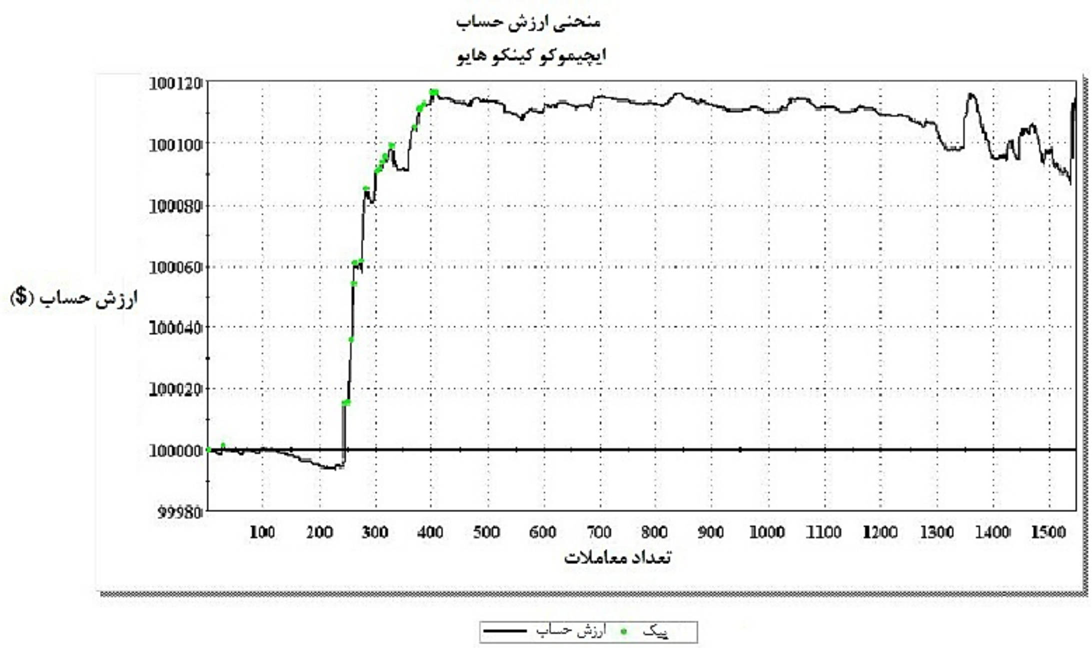


شکل ۳۹ روند قیمت KC.NON از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز نقره (SL.LNG)



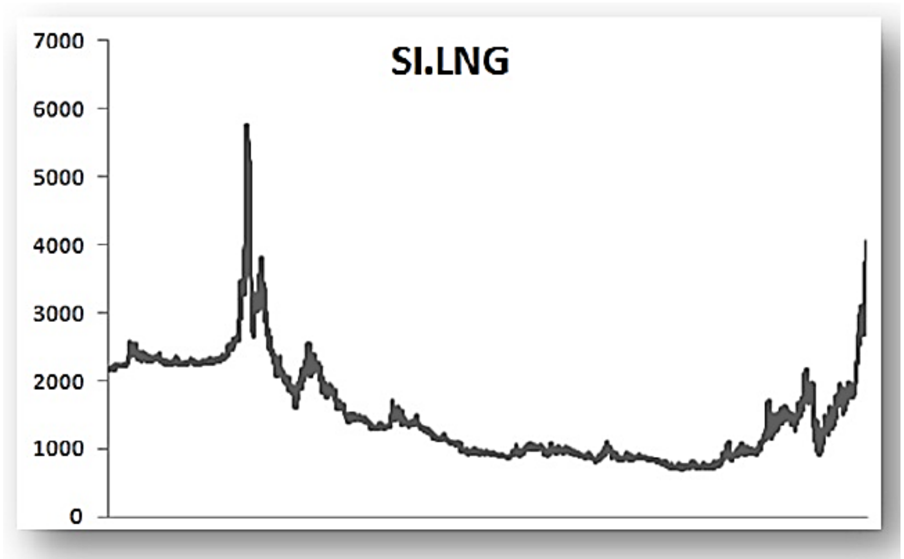
شکل ٤٠ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از نوامبر ۲۰۰۹ تا آوریل ۲۰۱۰



شکل ٤١ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۵۴۷
نرخ موفقیت	%۴۲٫۶۶
میانگی سود و زیان	۲٫۰۵
شاخص سودآوری	۱٫۵۳

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت ابتدا در جهت های یک طرفه حرکت می کند و سپس صعود می کند. در ادامه افت شدید قیمت به حرکات یک طرفه با حرکات جزئی رو به بالا و رو به پایین تبدیل می شود. و در قسمت آخر دوباره قیمت صعود می کند. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV نیز از ۲٫۰ بزرگ تر است که باعث می شود IKH2 استراتژی بالقوه برای SL.LNG باشد.

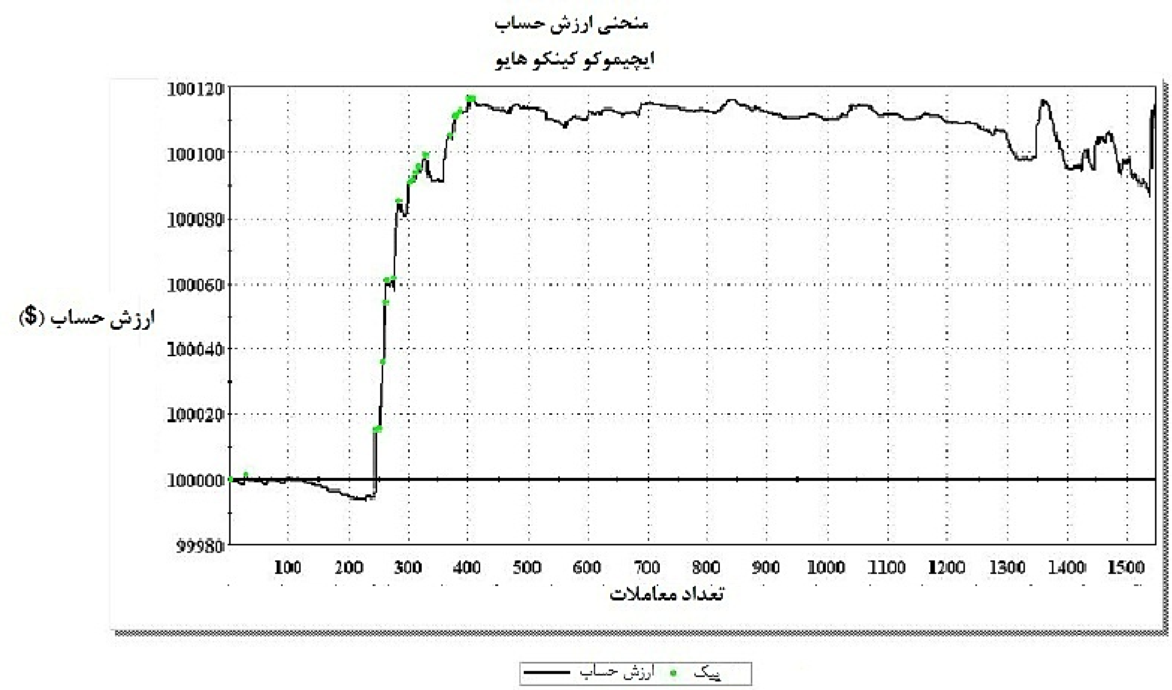


شکل ۴۲ روند قیمت SL.LNG از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز نقره (SL.NON)



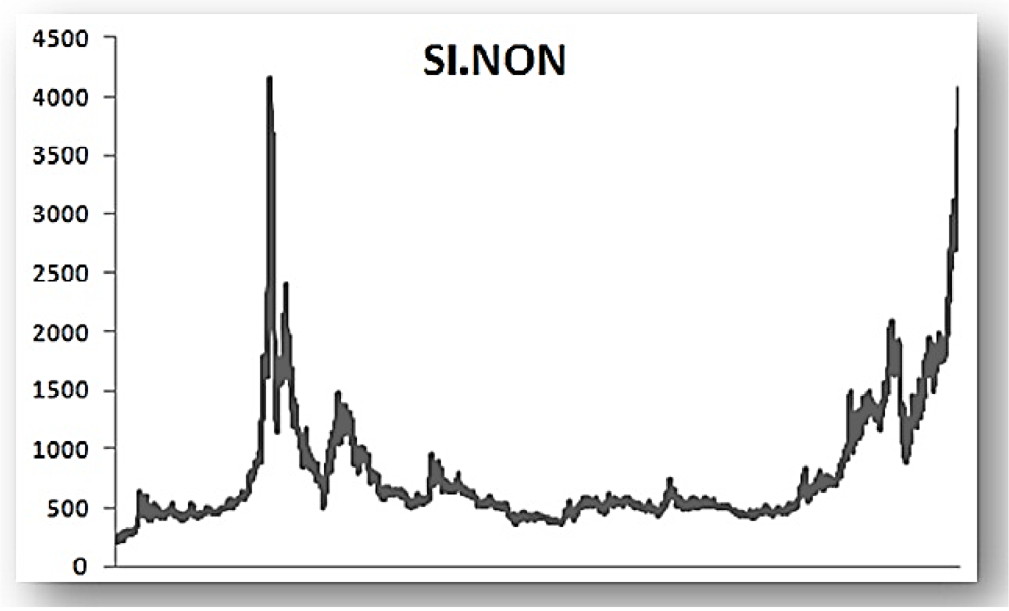
شکل ٤٣ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی از نوامبر ۲۰۰۹ تا آوریل ۲۰۱۰



شکل ٤٤ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، خنثی از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۷۰۶
نرخ موفقیت	%۴۲٫۴۴
میانگی سود و زیان	۱٫۹۷
شاخص سودآوری	۱٫۴۵

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین قوی مشاهده می شود. نرخ موفقیت تقریباً ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، با این حال هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.



شکل ٤٥ روند قیمت SL.NON از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

جدول مقابل فهرستی از بیست و هشت بازار و نتایج متناظر آنها برای اجرای IKHS2 ارائه می کند. قیمت نقره، فیوچرز و فیوچرز نقره به نتایج مطلوبی منجر شد. پنج بازار دیگر از مجموع بیست و هشت بازار نیز به نتایج مطلوب نزدیک هستند. با نگاهی به دیگر بازارها نیز نتیجه می گیریم که IKHS2 نباید به‌صورت نسخه اصلی آن به کار گرفته شود.

داده‌ها	تعداد معاملات	نرخ موفقیت	میانگین سود و زیان	شاخص سودآوری
Coffee$	۱۲۰۱	۵۶,۲۴	۰,۹۲	۱,۱۸
Cotton$	۱۵۶۰	۵۲,۰۱	۱,۱۲	۱,۲۱
DAX$	۶۳۱	۵۲,۳۹	۱,۲۸	۱,۱۶
Gold$	۱۵۹۷	۵۱,۲۴	۰,۸۶	۰,۹
Silver$	۱۷۱۵	۵۰,۰۹	۱,۲۵	۱,۲۵
SPX$	۲۸۵	۵۰,۲۳	۰,۹	۰,۹۱
Wheat$	۱۵۴۴	۴۸,۵۱	۰,۸۲	۰,۷۸
WTCRUDE$	۱۱۸۵	۵۱,۹۹	۰,۹۹	۱,۰۸
AX.LNG	۴۸۵	۵۱,۴	۱,۴۹	۱,۸۶
AX.NON	۴۵۵	۵۱,۹۵	۱,۲۶	۱,۳۶
CL.LNG	۹۴۴	۵۲,۷۸	۱,۸۴	۲,۰۵
CL.NON	۱۰۷۵	۵۳,۵۵	۱,۵۷	۱,۸۲
CR.LNG	۱۱۷۲	۴۸,۵۶	۱,۲۷	۱,۲
CT.NON	۱۴۸۹	۵۰,۱۱	۱,۲	۱,۲

داده‌ها	تعداد معاملات	نرخ موفقیت	میانگین سود و زیان	شاخص سودآوری
EURUSD	۴۹۲	۵۸,۵۴	۰,۷۴	۱,۰۴
FX.LNG	۱۲۴۳	۵۱,۸۹	۰,۹۲	۰,۹۹
FX.NON	۱۳۹۵	۶۴,۱۵	۰,۶۸	۱,۲۱
GC.LNG	۱۳۷۰	۵۲,۱۳	۰,۹۴	۱,۰۳
GC.NON	۱۵۰۱	۵۲,۸۷	۰,۸	۰,۹
INDU	۳۳۱۰	۵۰,۷۹	۱	۱,۰۳
JN.NON	۸۷۸	۵۰,۶	۱,۱۴	۱,۱۱
KC.LNG	۱۴۱۴	۵۳,۲	۱,۳۹	۱,۵۸
KC.NON	۱۵۵۰	۴۸,۲۸	۱,۴۳	۱,۳۳
SI.LNG	۱۵۴۷	۴۸,۶۶	۱,۱۸	۱,۱۲
SI.NON	۱۷۰۶	۴۹,۴۴	۱,۱۴	۱,۱۲
USDJPY	۵۷۰	۵۳,۹۵	۰,۹۷	۱,۱۳
W_.LNG	۱۵۹۶	۵۲,۸۶	۰,۹۹	۱,۱۲
W_.NON	۱۷۰۸	۵۳,۲۳	۰,۸۴	۰,۹۶

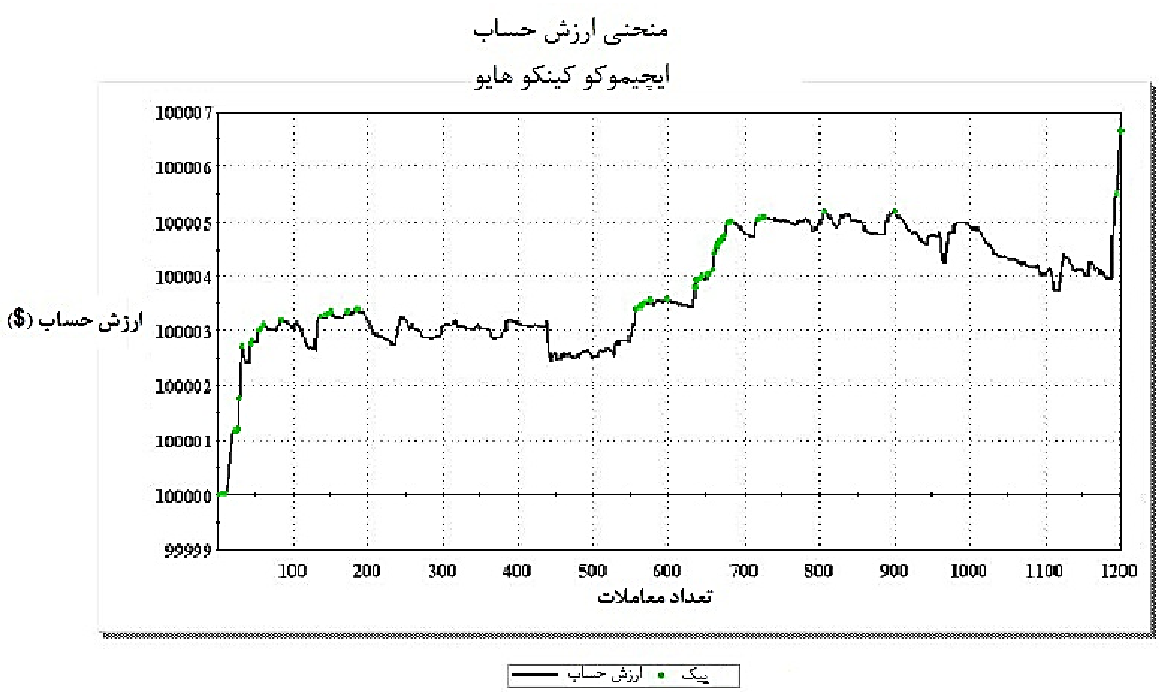
جدول ۲ ۲۸ بازارو IKHS2 متناظر

٤,١,٣. IKH با سیگنال های قوی

کتان ($Cotton)



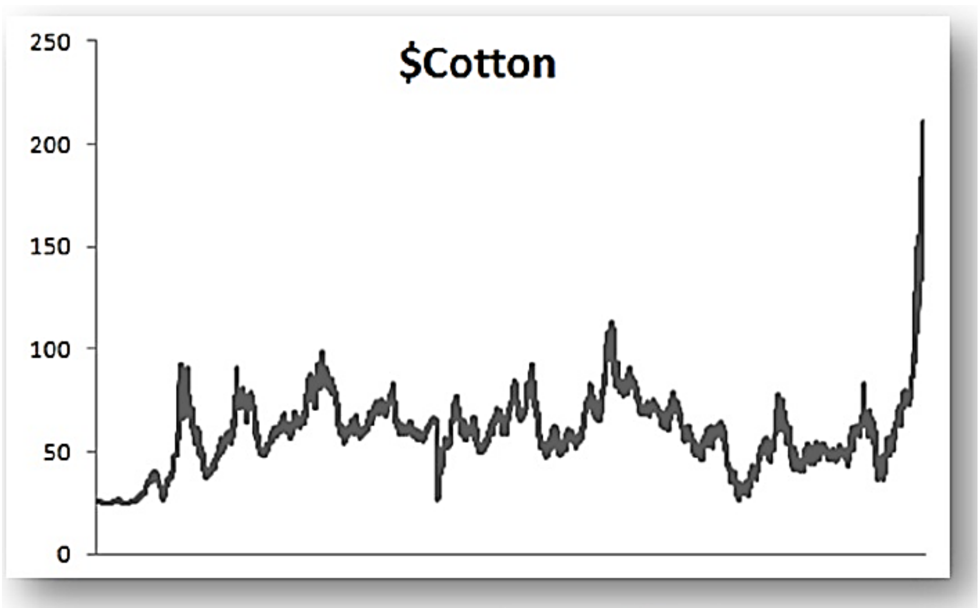
شکل ٤٦ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از اکتبر ۲۰۱۰ تا ژانویه ۲۰۱۱



شکل ٤٧ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۲۰۳
نرخ موفقیت	۴۳٫۰۶%
میانگین سود و زیان	۱٫۸۸
شاخص سودآوری	۱٫۴۲

منحنی ارزش حساب به طور پیوسته صعود نمی کند. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین و به دنبال آن صعود قوی مشاهده می شود. نرخ موفقیت بالاتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، با این حال هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

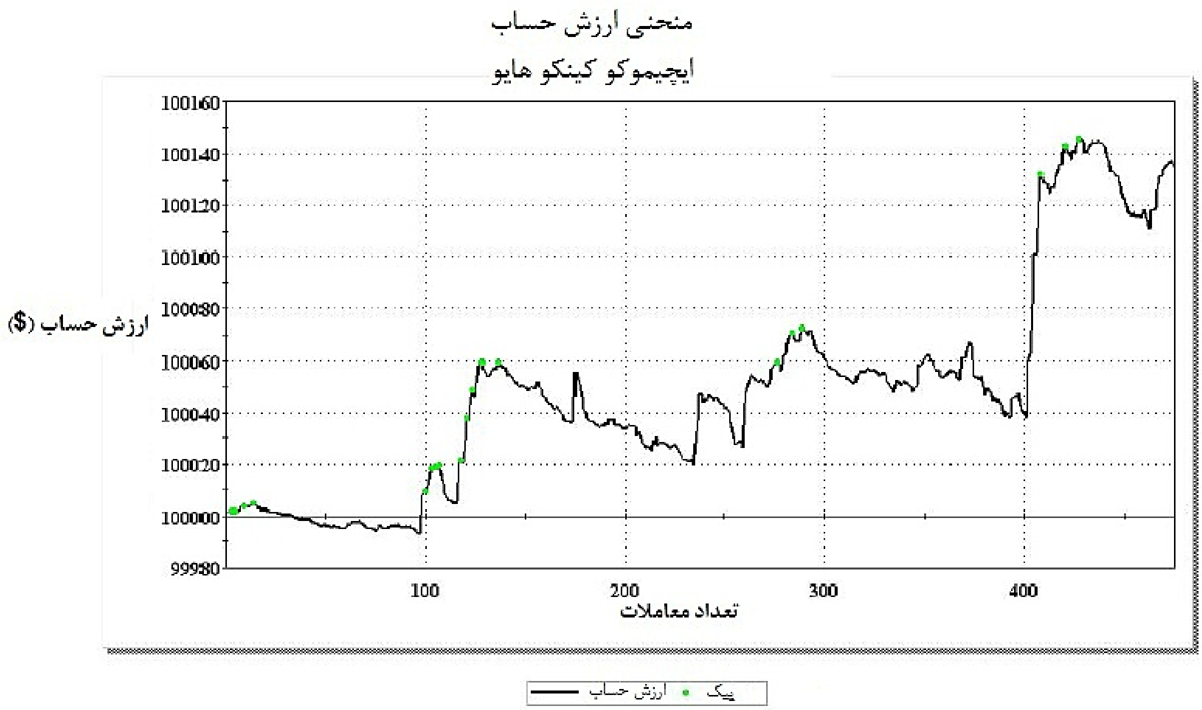


شکل ٤٨ روند قیمت $Cotton از ١٩٦٩/٠٦/٠٢ تا ٢٠١١/٠٤/٠٨

($DAX) DAX



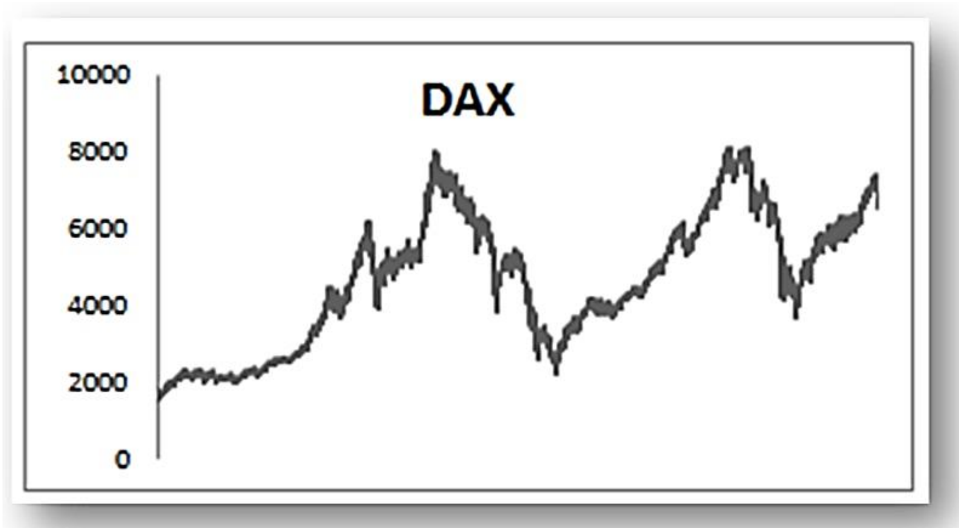
شکل ۴۹ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از می تا سپتامبر ۲۰۰۹



شکل ۵۰ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۹۲/۰۱/۳۱ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲۲

تعداد معاملات	۴۷۵
نرخ موفقیت	%۴۰٫۲۱
میانگین سود و زیان	۲٫۰۹
شاخص سودآوری	۱٫۴۱

منحنی ارزش حساب باید به طور پیوسته صعود کند. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین تکرار شونده مشاهده می شود. نرخ موفقیت بالاتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV از ۲٫۰ بزرگ تر است، و بر این اساس IKHS2 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای DAX باشد.

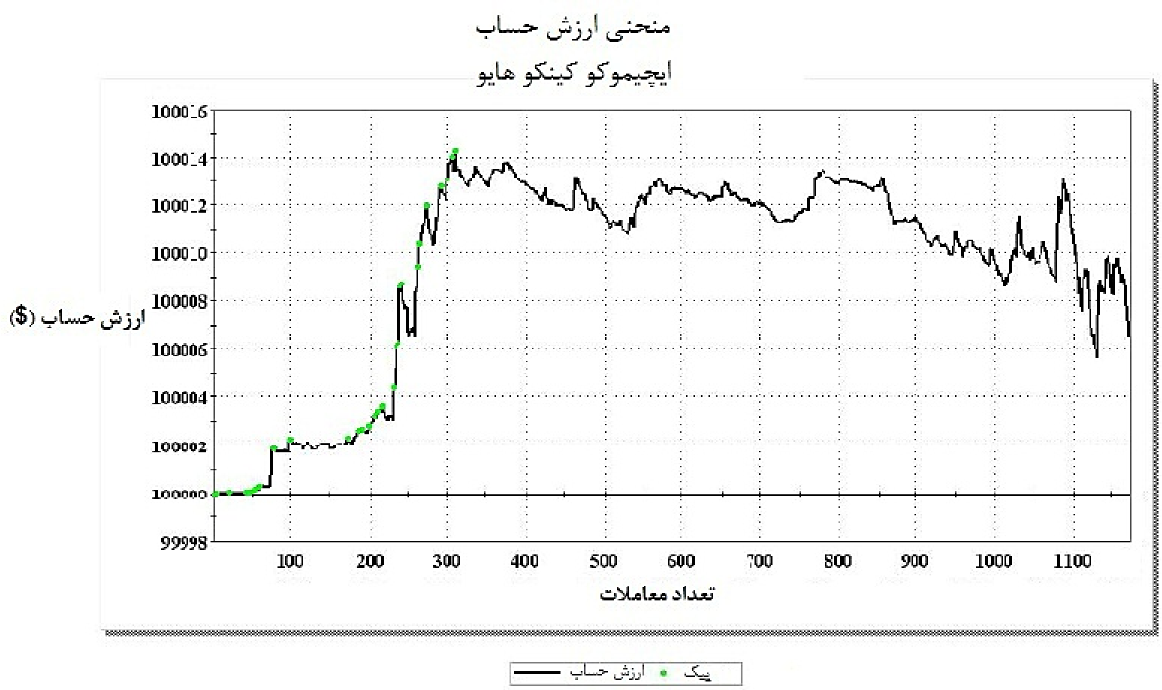


شکل ۵۱ روند قیمت DAX از ۱۹۹۲/۰۱/۳۱ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲۲

طلا ($Gold)



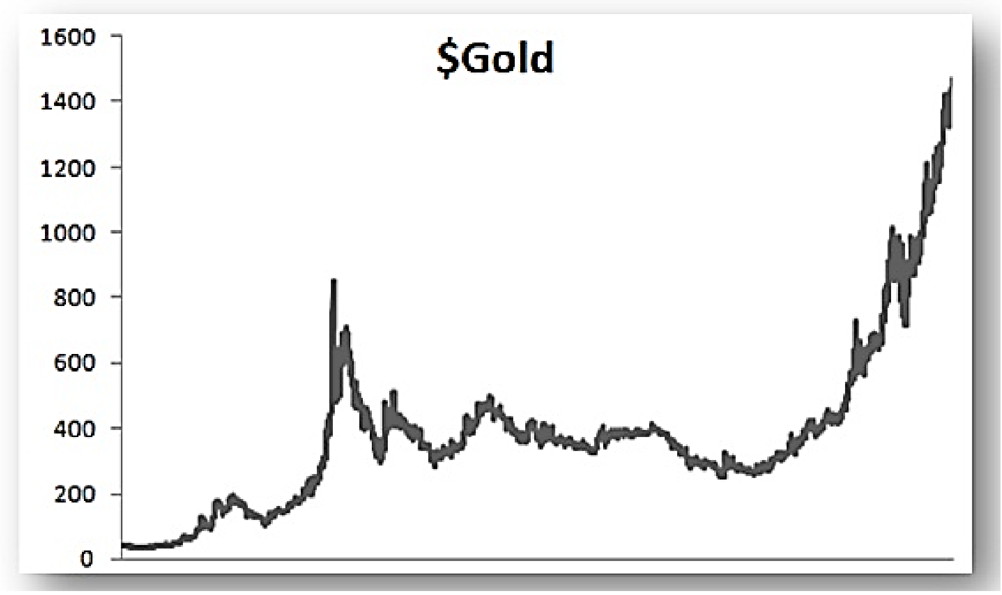
شکل ۵۲ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از فوریه تا ژوئن ۲۰۰۸



شکل ۵۳ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

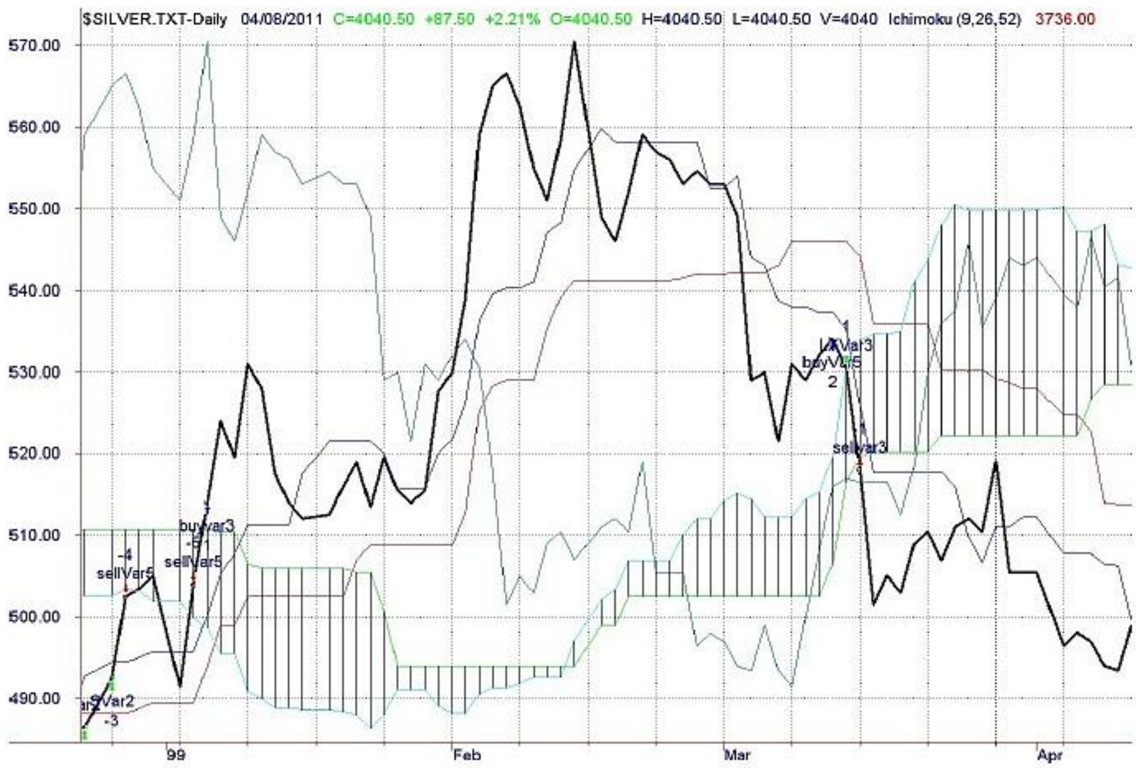
تعداد معاملات	۱۱۷۳
نرخ موفقیت	%۴۰٫۷۵
میانگین سود و زیان	۱٫۶۱
شاخص سودآوری	۱٫۱۱

منحنی ارزش حساب به‌طور پیوسته صعود نمی کند. در روند قیمت حرکات رو به بالا و رو به پایین مشاهده می شود. در انتها افزایش بسیار قوی دارد. نرخ موفقیت بالاتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

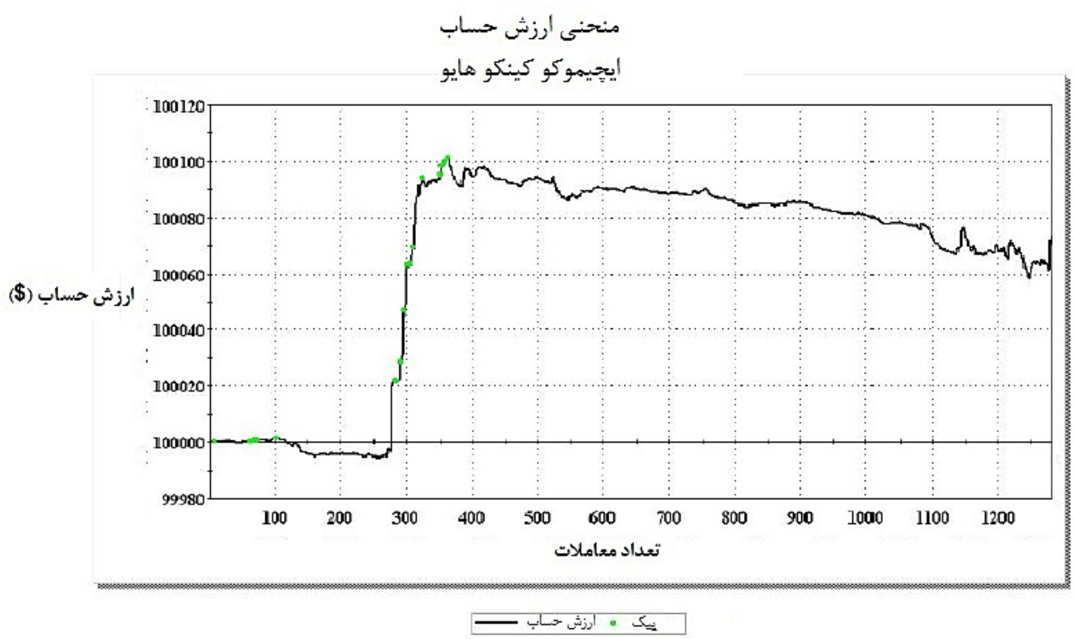


شکل ٥٤ روند قیمت $Gold از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

نقره ($Silver)



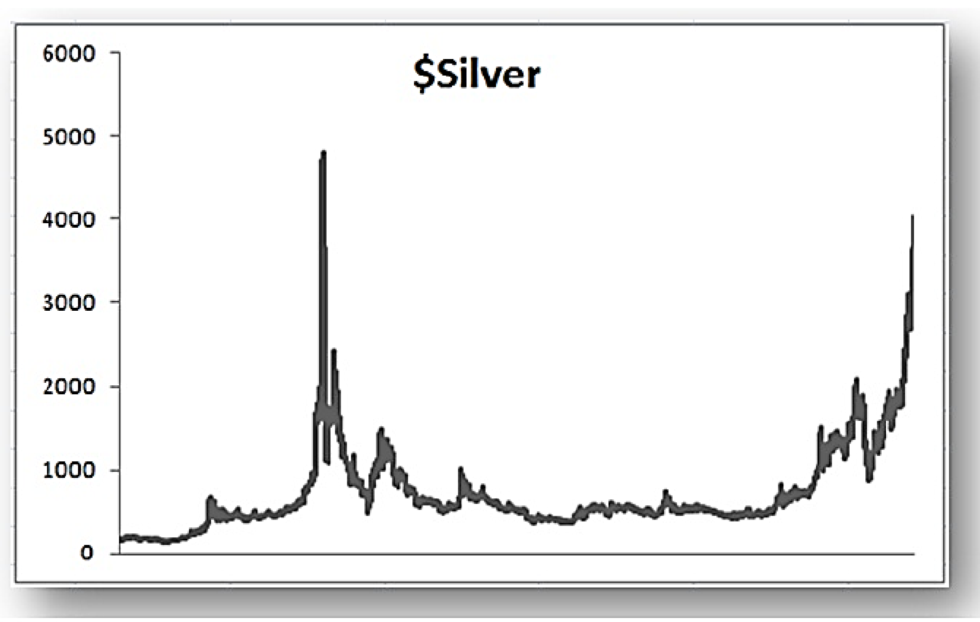
شکل ۵۵ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژانویه تا آوریل ۱۹۹۹



شکل ٥٦ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

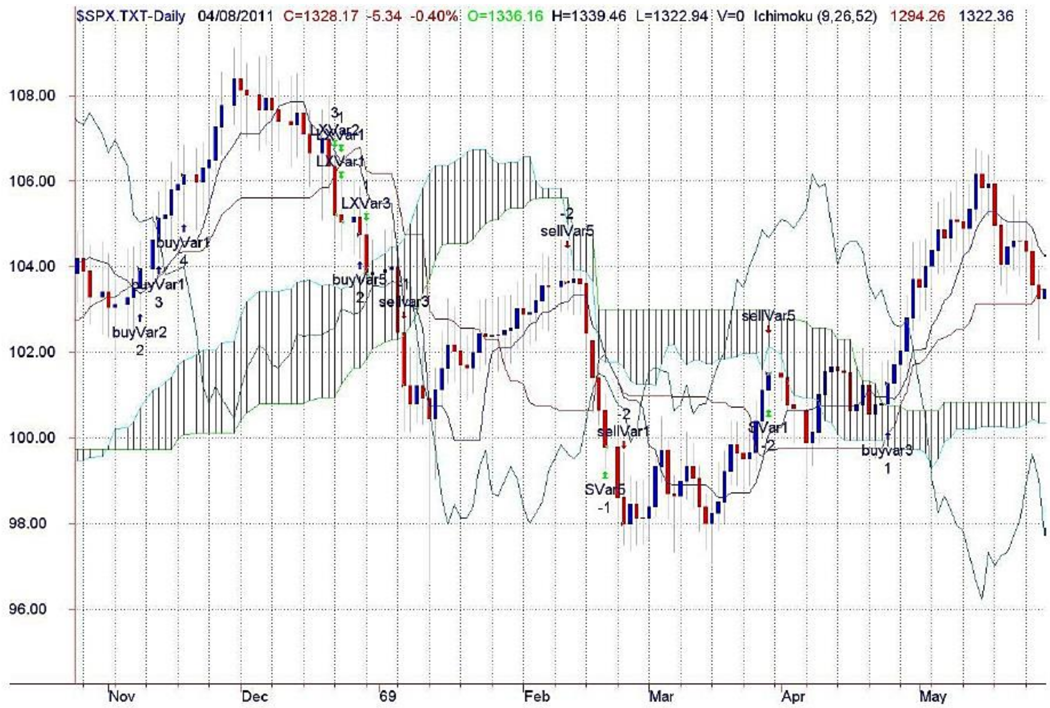
تعداد معاملات	۱۲۸۱
نرخ موفقیت	%۳۹٫۴۲
میانگی سود و زیان	۲٫۲۴
شاخص سودآوری	۱٫۴۶

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند، و روند آن دو بار با صعود شدید و افت شدید قطع می شود. نرخ موفقیت تقریباً ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است که باعث می شود IKHS3 استراتژی بالقوه برای قیمت نقره باشد.

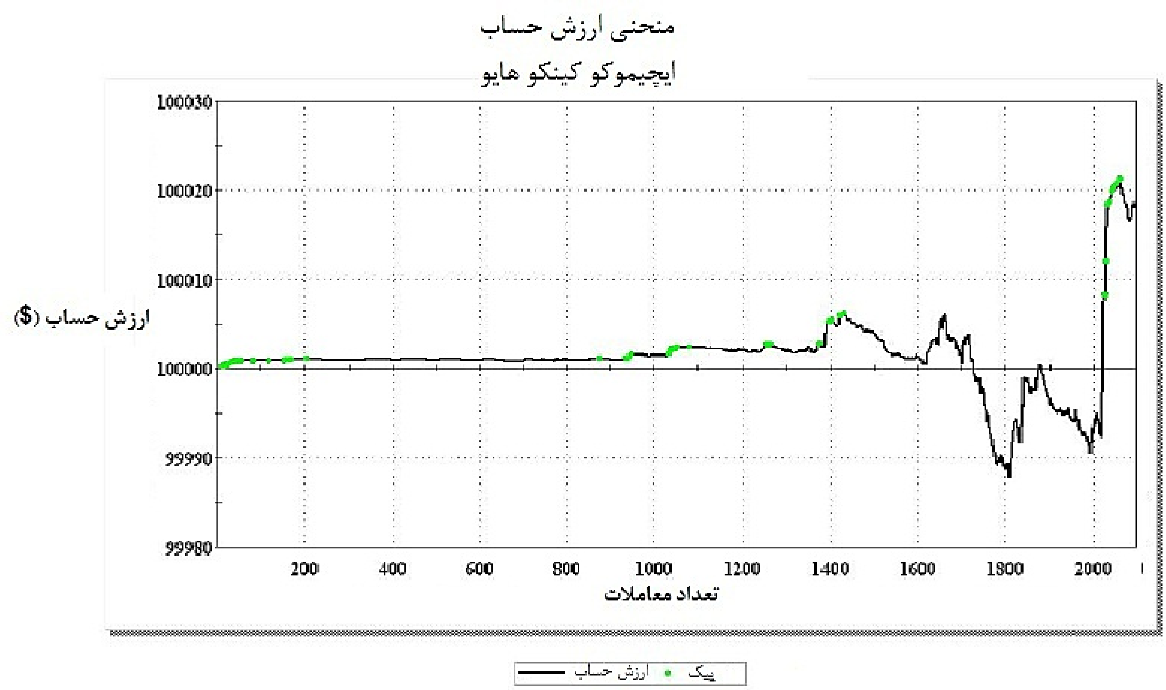


شکل ۵۷ روند قیمت $Gold از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

($SPX) S&P500



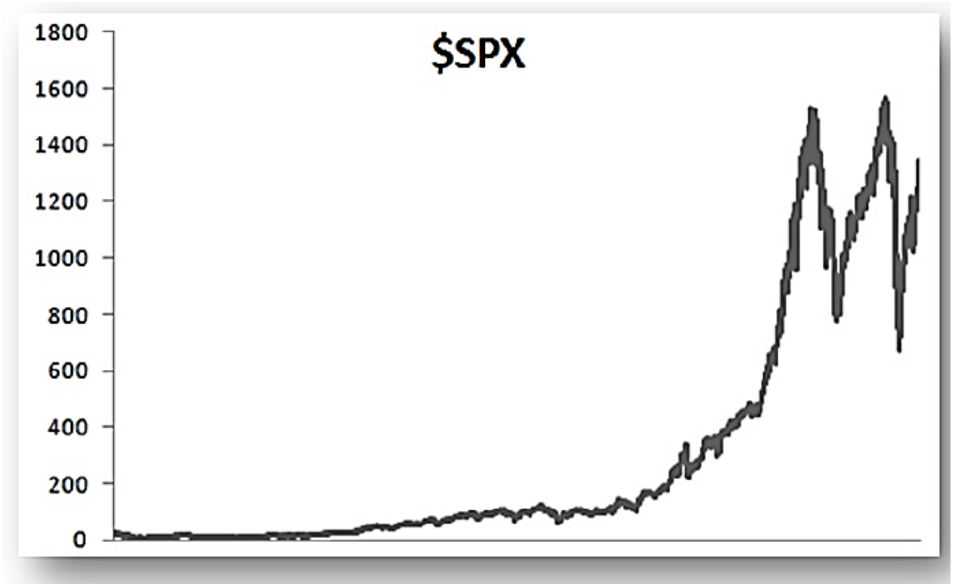
شکل ۵۸ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از نوامبر ۱۹۶۸ تا می ۱۹۶۹



شکل ۵۹ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۲۰۹۵
نرخ موفقیت	%۴۱٫۱۹
میانگی سود و زیان	۱٫۷۴
شاخص سودآوری	۱٫۲۲

منحنی ارزش حساب به طور پیوسته صعود نمی کند. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند، و درنهایت به حرکت صعودی با حرکات روبه بالا و رو به پایین بعد از آن منجر می شود. نرخ موفقیت تقریباً ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است،با این حال، هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

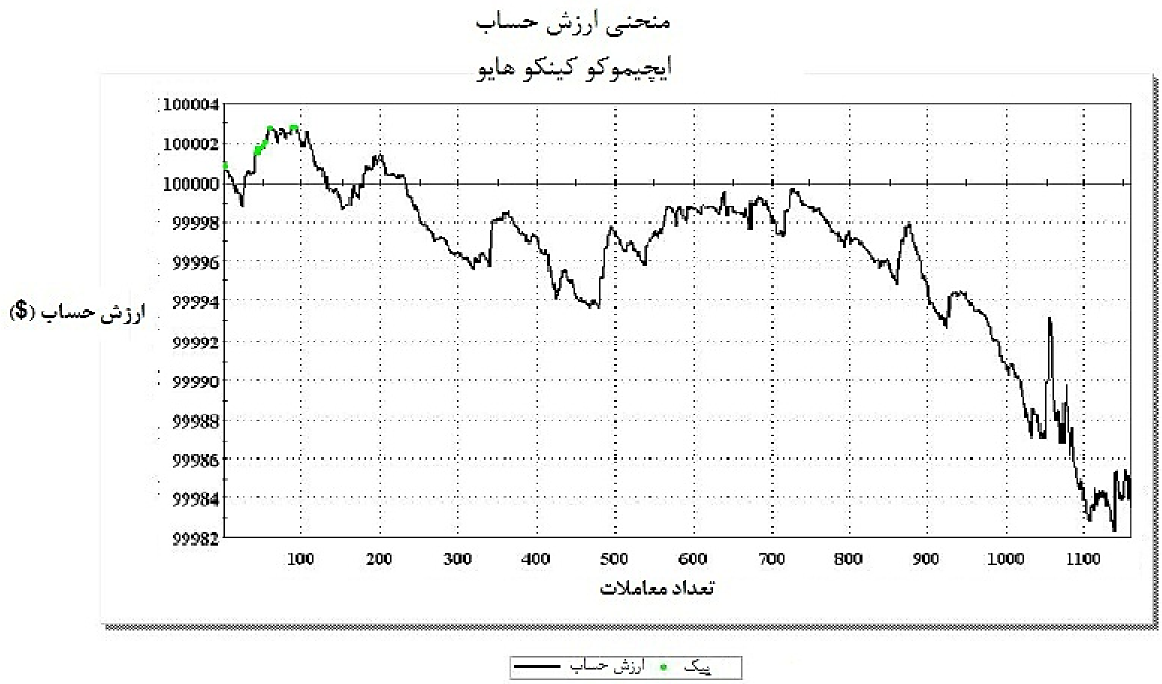


شکل ٦٠ روند قیمت S&P500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

گندم ($Wheat)



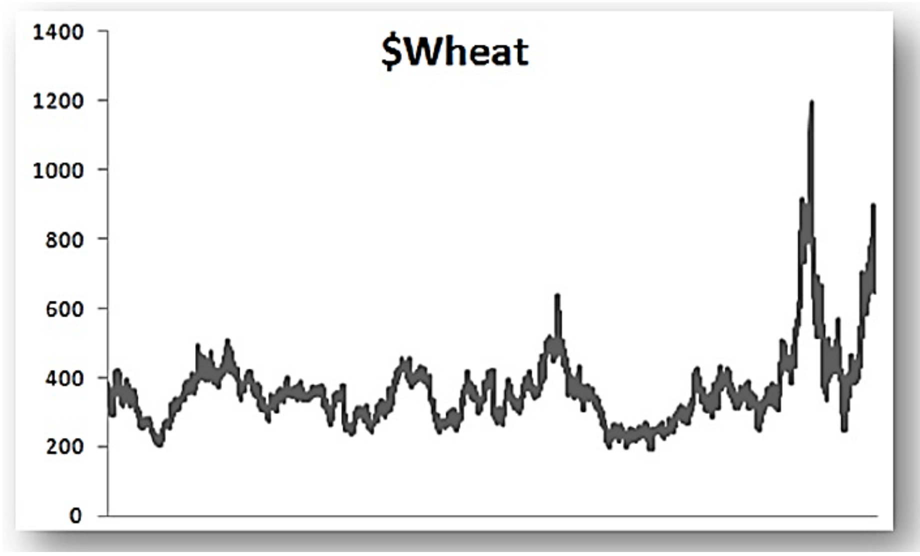
شکل ٦١ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از سپتامبر ۲۰۰۹ تا ژانویه ۲۰۱۰



شکل ٦٢ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ١٩٧٥/٠٤/٠٤ تا ٢٠١١/٠٤/٠٨

تعداد معاملات	۱۱۵۹
نرخ موفقیت	%۳۸٫۰۵
میانگی سود و زیان	۱٫۳۵
شاخص سودآوری	۱٫۸۳

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند. درنهایت قیمت با حرکت صعودی شدید، و سپس سقوط و دوباره صعود می کند. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند

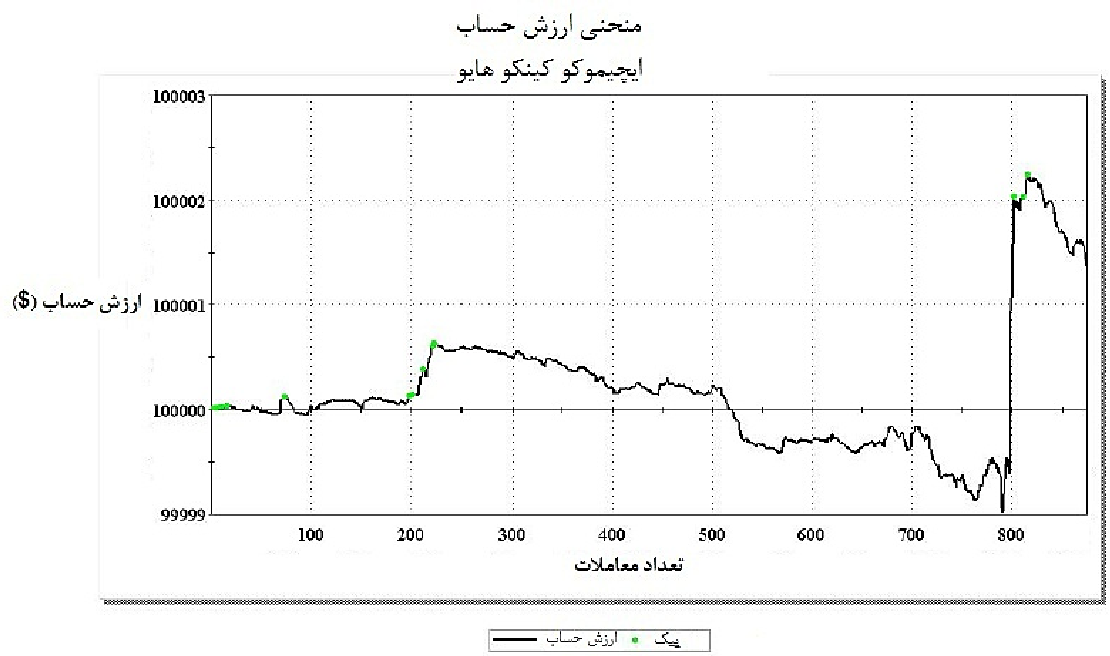


شکل ٦٣ روند قیمت Wheat$ از ۱۹۷۵/۰٤/۰٤ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

نفت (WTCRUDE$)



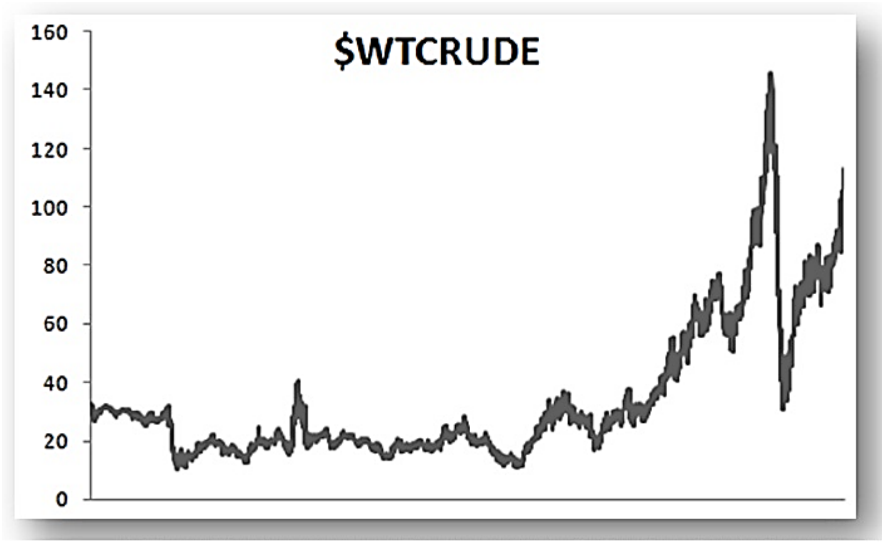
شکل ٦٤ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژانویه تا اکتبر ۲۰۰۸



شکل ٦٥ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۸۳/۰۱/۱۰ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

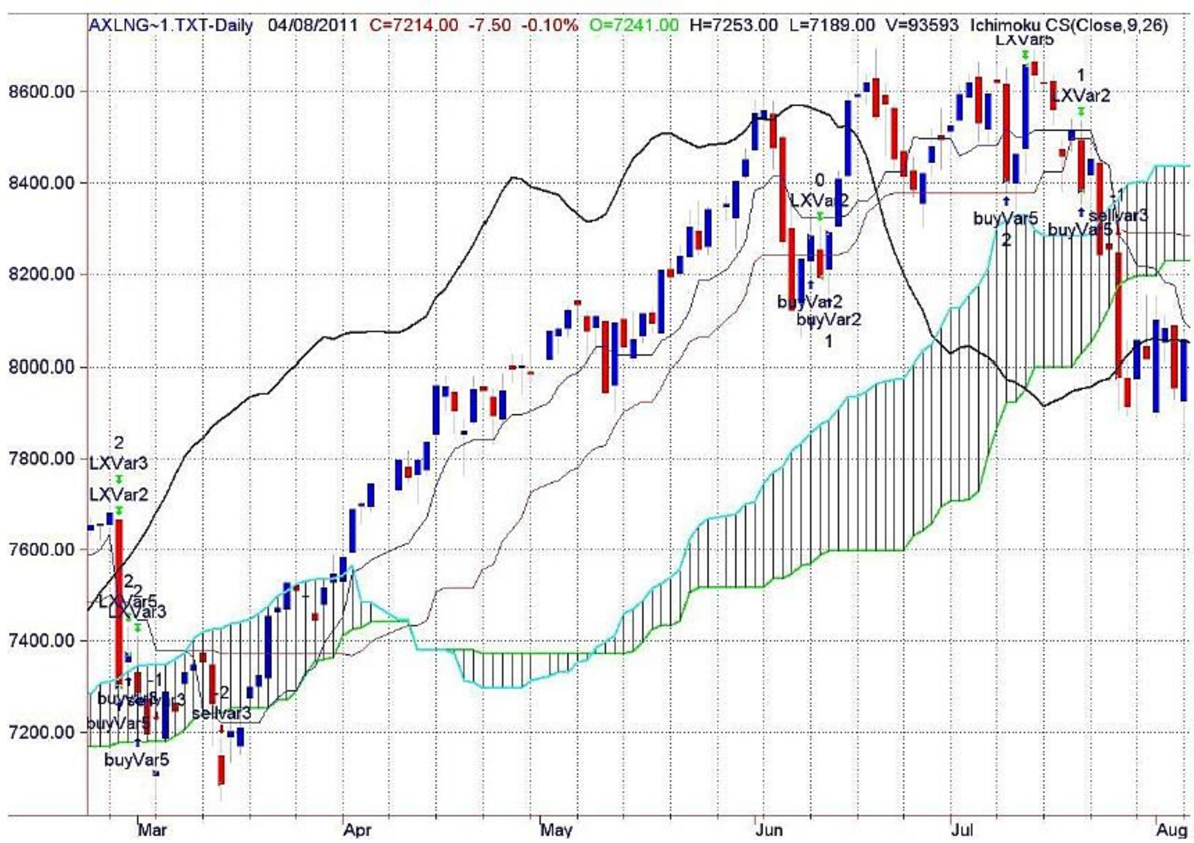
تعداد معاملات	۸۷۵
نرخ موفقیت	%۴۱٫۱۴
میانگین سود و زیان	۱٫۷۱
شاخص سودآوری	۱٫۱۹

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند. درنهایت قیمت به شدت افزایش می یابد ، و سپس افت می‌کند و دوباره افزایش می‌یابد. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند

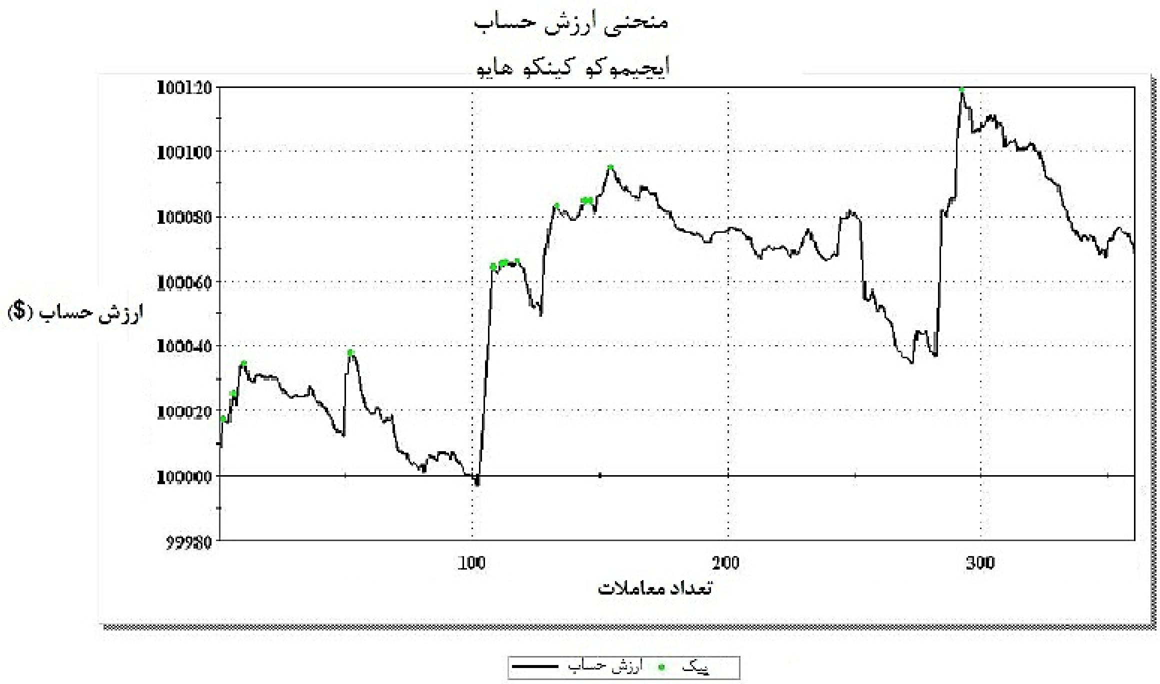


شکل ٦٦ روند قیمت WTCRUDE$ از ۱۹۸۳/۰۱/۱۰ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز DAX (AX.LNG)



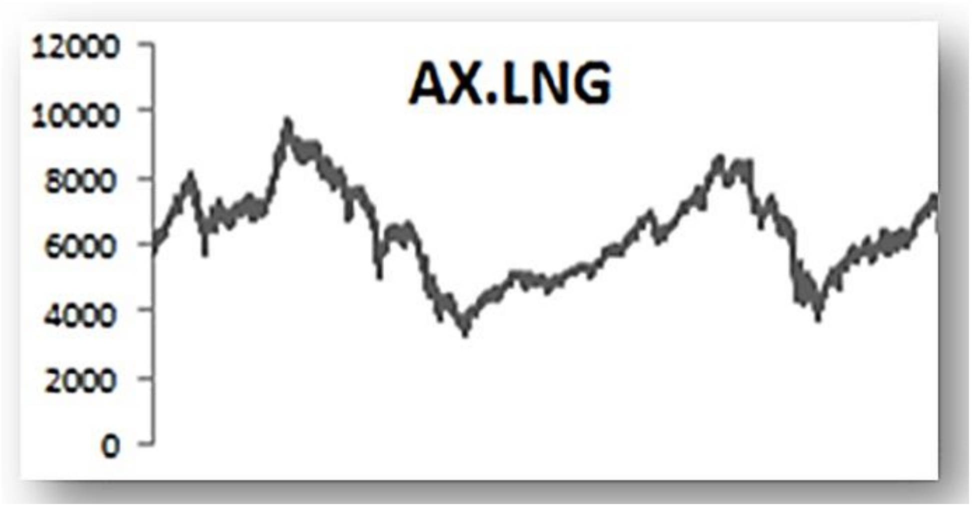
شکل ٦٧ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از مارس تا اوت ۲۰۰۷



شکل ٦٨ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۹۷/۱۱/۰۵ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

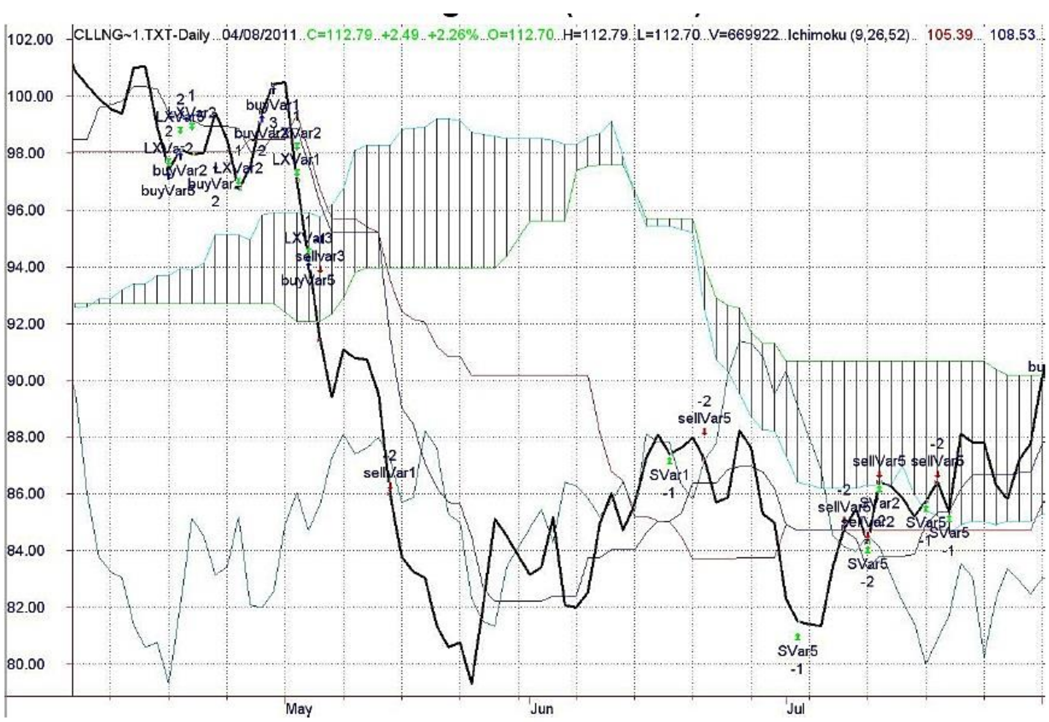
تعداد معاملات	۳۶۰
نرخ موفقیت	%۳۸٫۶۱
میانگین سود و زیان	۱٫۹۴
شاخص سودآوری	۱٫۲۲

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت دارای حرکات رو به بالا و رو به پایین است. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و میانگین سود و زیان و شاخص سودآوری بزرگ تر از ۱٫۰ است، با این حال هیچ کدام بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.

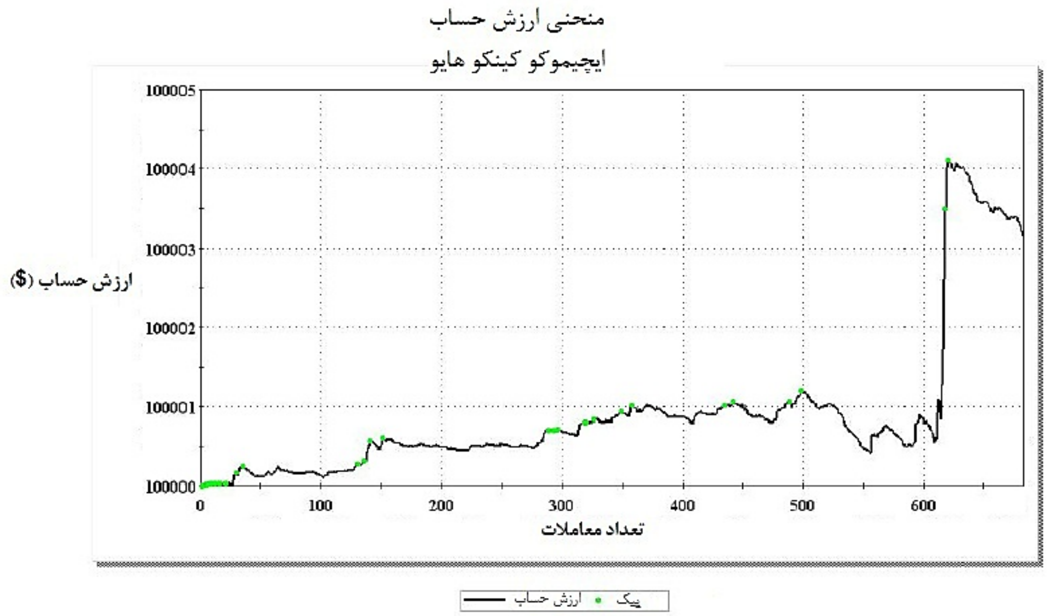


شکل ٦٩ روند قیمت AX.LNG از ۱۹۹۷/۱۱/۰۵ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز نفت (CL.LNG)



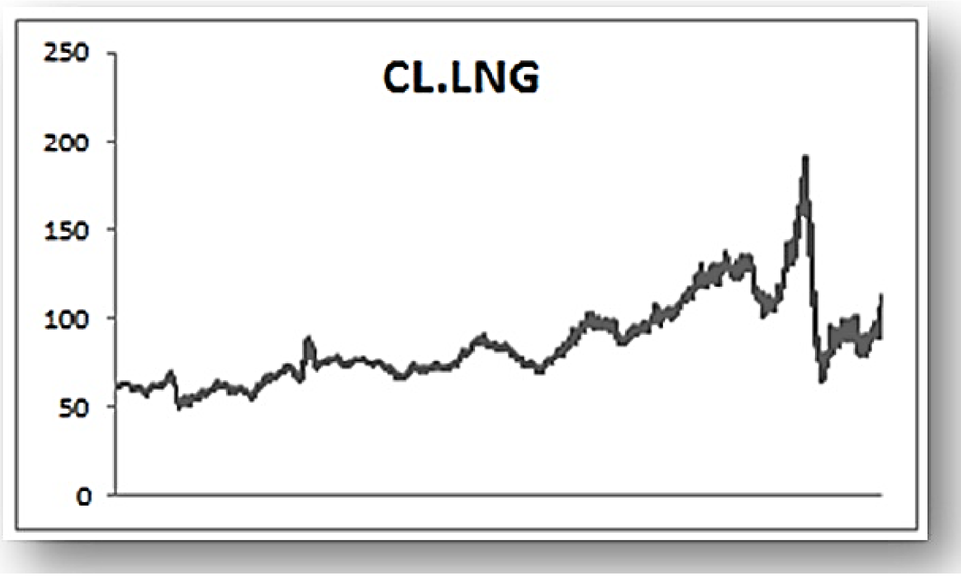
شکل ۷۰ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از آوریل تا اوت ۲۰۱۰



شکل ۷۱ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۶۸۲
نرخ موفقیت	%۴۲٫۳۸
میانگین سود و زیان	۲٫۱۶
شاخص سودآوری	۱٫۵۹

در اینجا نیز منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت ابتدا حرکت افقی همراه با حرکات جزئی رو به بالا و رو به پایین دارد. از نیمه تا انتها افزایش قیمت و در ادامه افت شدید قیمت وجود دارد. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV از ۲٫۰ بزرگ تر است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بالقوه برای CL.LNG محسوب شود.

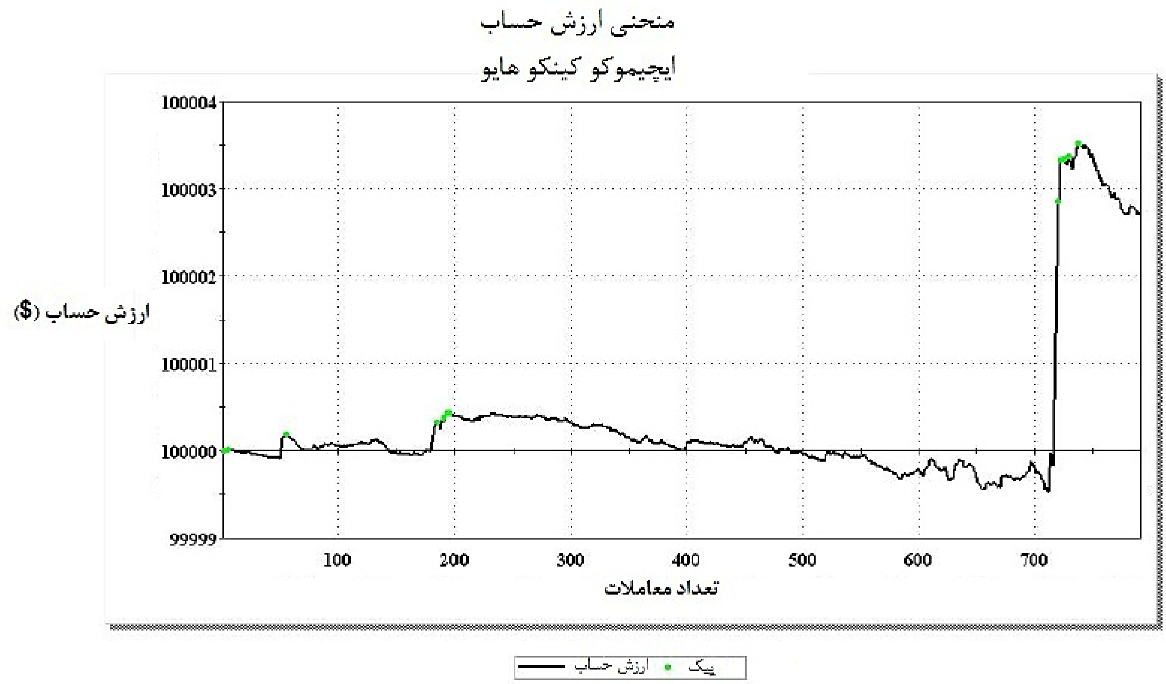


شکل ۷۲ روند قیمت CL.LNG از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز نفت (CL.NON)



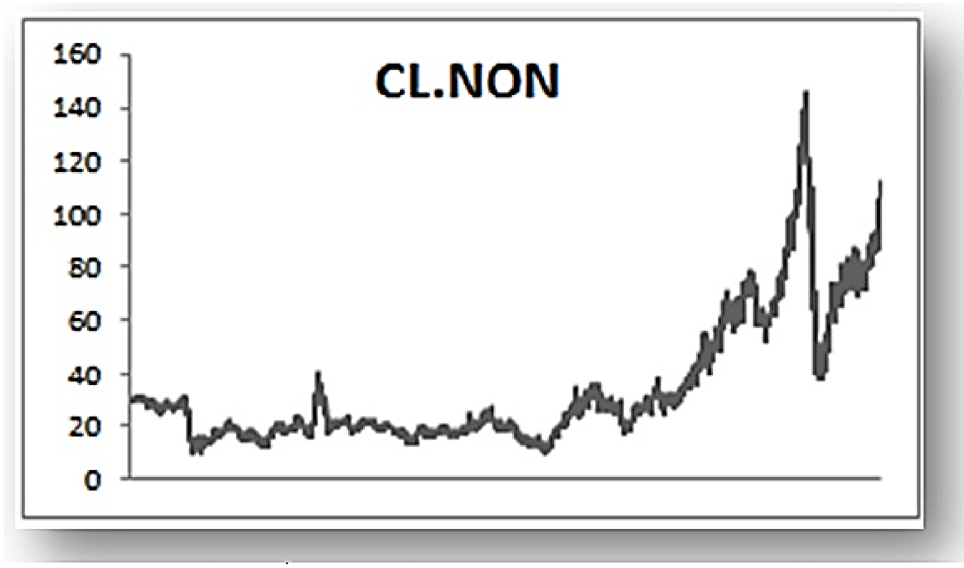
شکل ۷۳ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از می تا اوت ۲۰۱۰



شکل ٧٤ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ١٩٨٤/٠١/٠٣ تا ٢٠١١/٠٤/٠٨

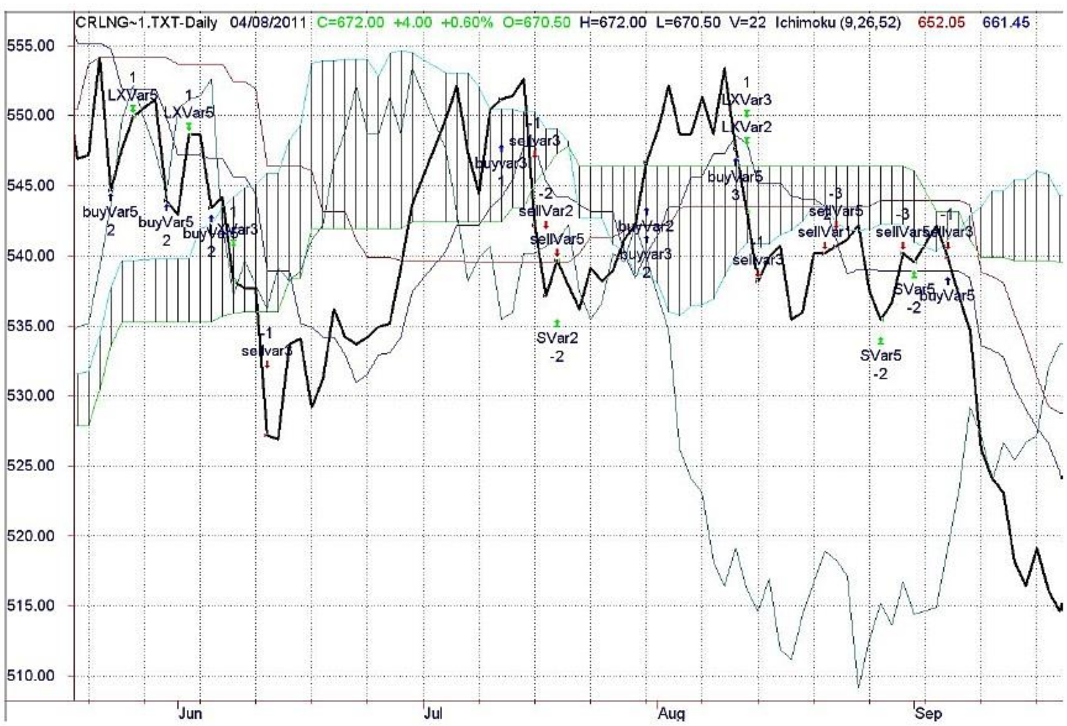
تعداد معاملات	۷۹۱
نرخ موفقیت	%۳۸٫۴۳
میانگی سود و زیان	۲٫۳۳
شاخص سودآوری	۱٫۴۶

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند. درنهایت قیمت افزایش می‌یابد، به دنبال آن افت شدید و سپس افزایش مشاهده می شود. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای CL.NON باشد

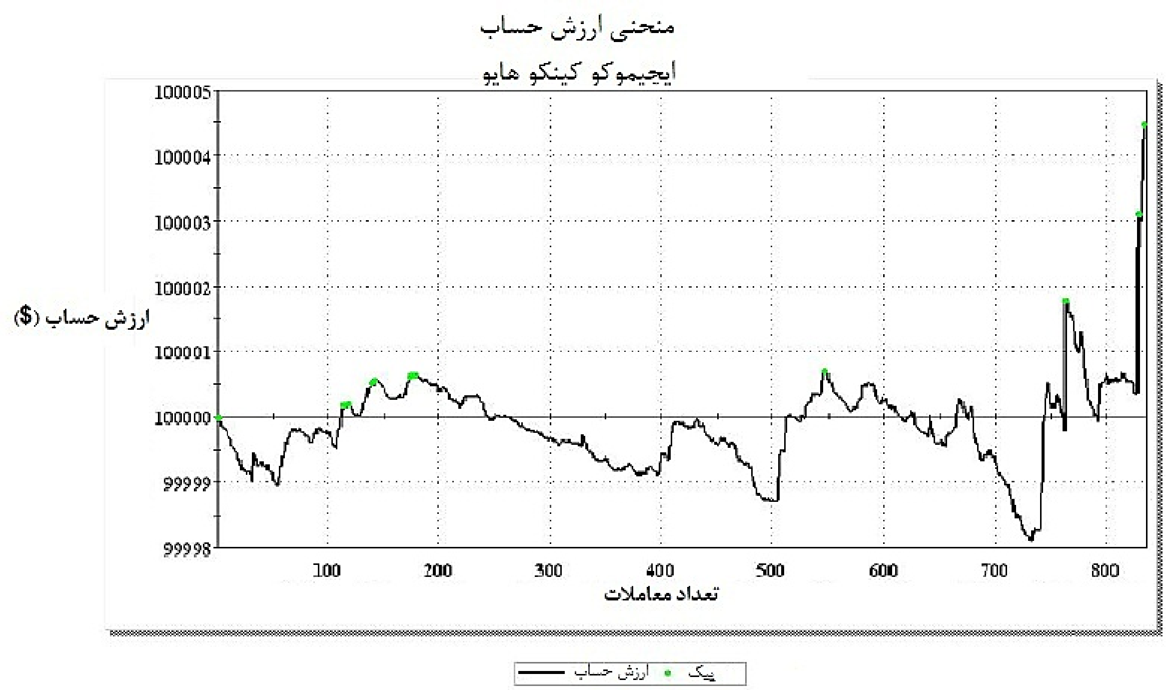


شکل ۷۵ روند قیمت CL.NON از ۱۹۸٤/۰۱/۰۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز CRB (CR.LNG)



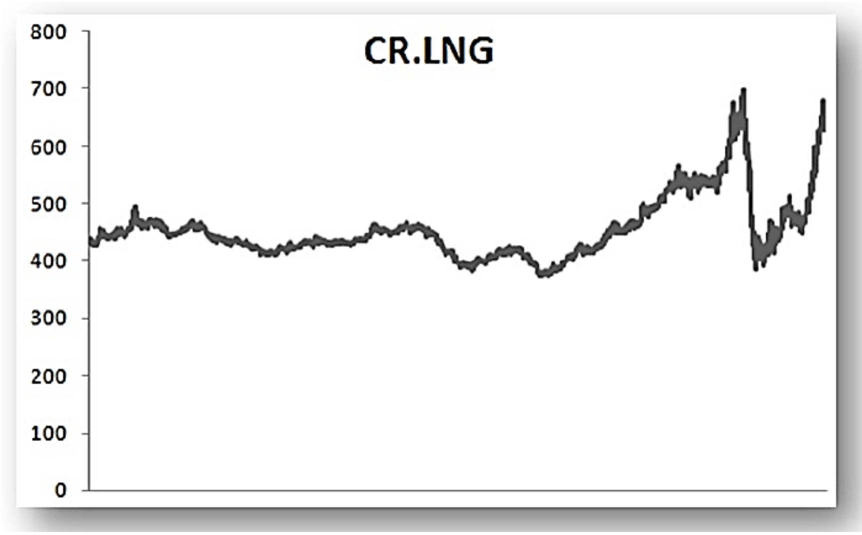
شکل ۷٦ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژوئن تا سپتامبر ۲۰۰٦



شکل ۷۷ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۸۷/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۸۳۶
نرخ موفقیت	۳۸٫۰۴%
میانگی سود و زیان	۲٫۰۵
شاخص سودآوری	۱٫۲۶

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. قیمت با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی در جهت های یک طرفه حرکت می کند. درنهایت قیمت افزایش می یابد، به دنبال آن افت شدید و سپس افزایش مشاهده می شود. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است، DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای CR.LNG باشد.

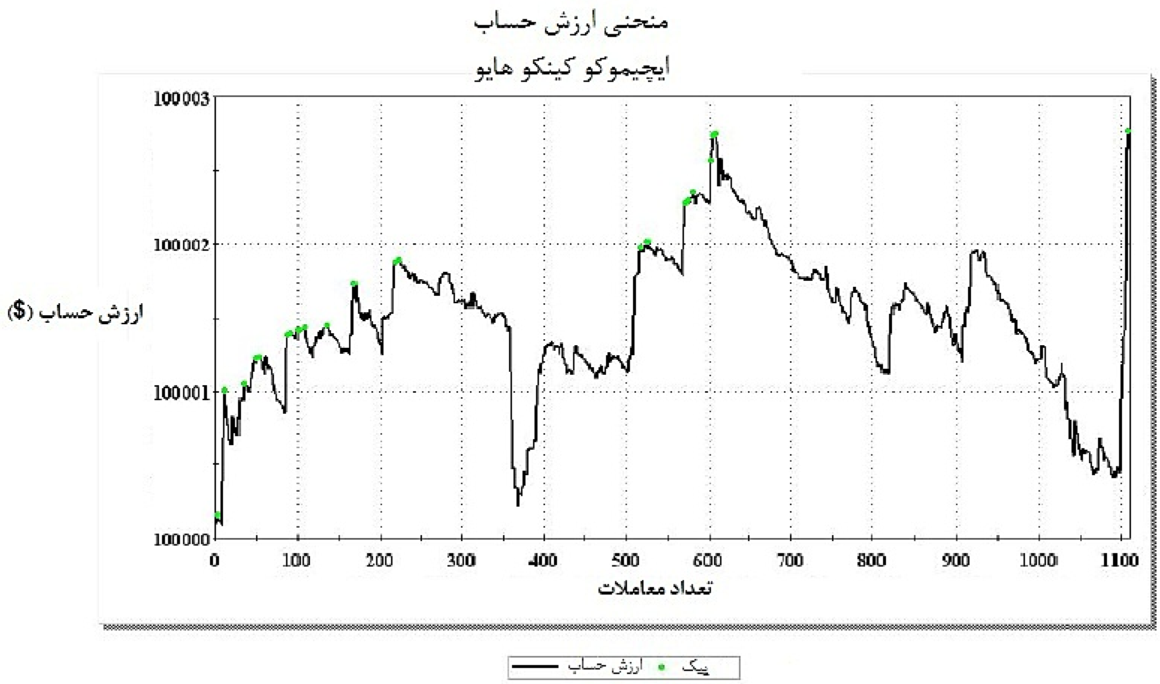


شکل ۷۸ روند قیمت CR.LNG از ۱۹۸۷/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز کتان (CT.NON)



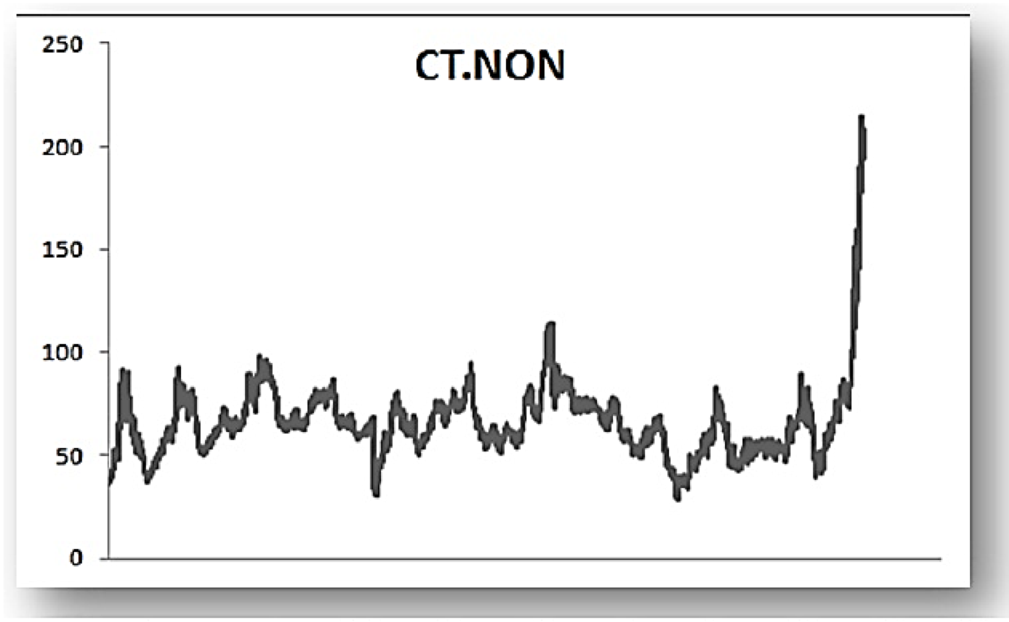
شکل ۷۹ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از سپتامبر ۲۰۱۰ تا فوریه ۲۰۱۱



شکل ۸۰ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

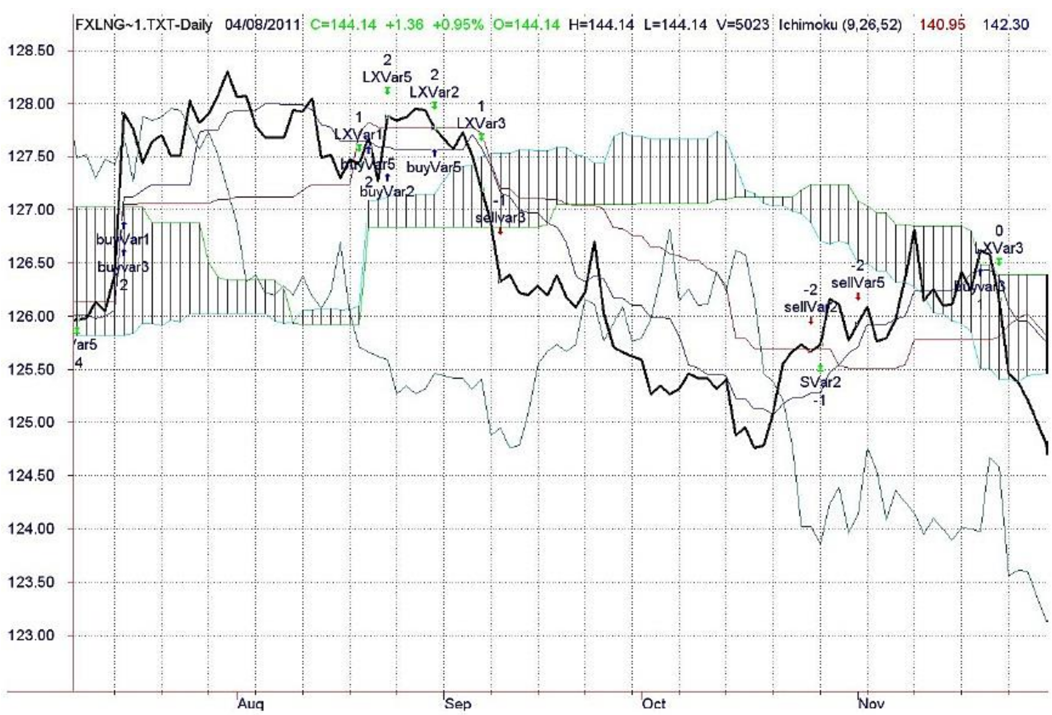
تعداد معاملات	۱۱۱۱
نرخ موفقیت	%۳۸٫۷۰
میانگین سود و زیان	۱٫۷۵
شاخص سودآوری	۱٫۱۱

پیشرفت منحنی ارزش حساب دارای نوسان است، و صعود پیوسته مشاهده نمی شود. در روند قیمت حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی مشاهده می شود. درنهایت قیمت شاهد افزایش قوی است. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

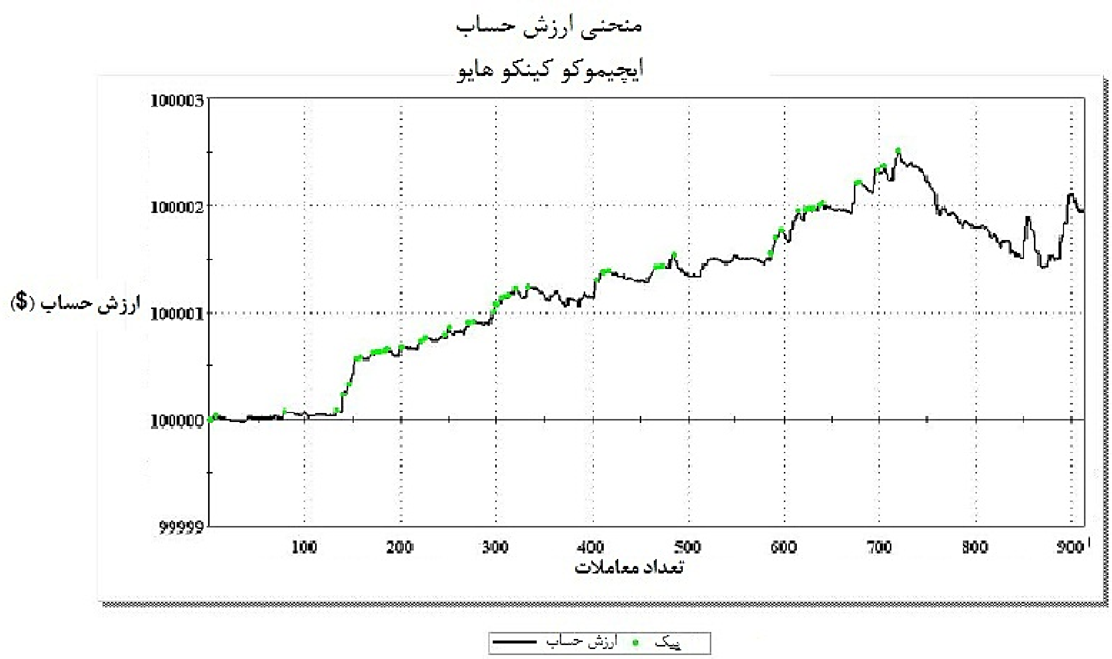


شکل ۸۱ روند قیمت CT.NO از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز Euro/Dollar (FX.LNG)



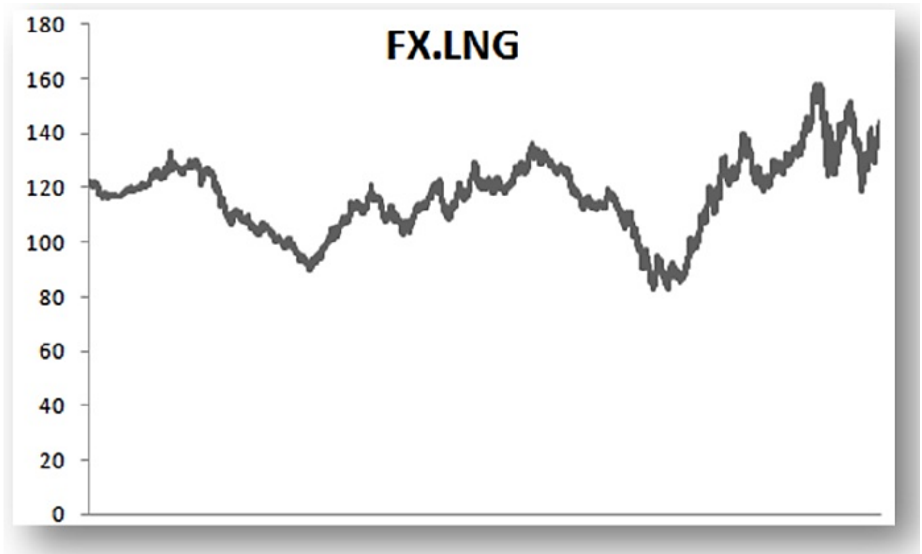
شکل ۸۲ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژوئیه تا دسامبر ۱۹۹۶



شکل ۸۳ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷۵/۰۲/۱۳ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۹۱۳
نرخ موفقیت	%۴۳٫۰۴
میانگین سود و زیان	۱٫۸۲
شاخص سودآوری	۱٫۸۳

منحنی ارزش حساب در ابتدا حرکت افزایشی دارد، سپس دوباره به‌طور جزئی افت می کند. در روند قیمت حرکات روبه بالا و رو به پایین مشاهده می شود. نرخ موفقیت بالاتر از ۴۰% و PF و DGV بزرگ تر از ۱٫۰ است. هر دو پارامتر از ۲٫۰ کوچک تر هستند.

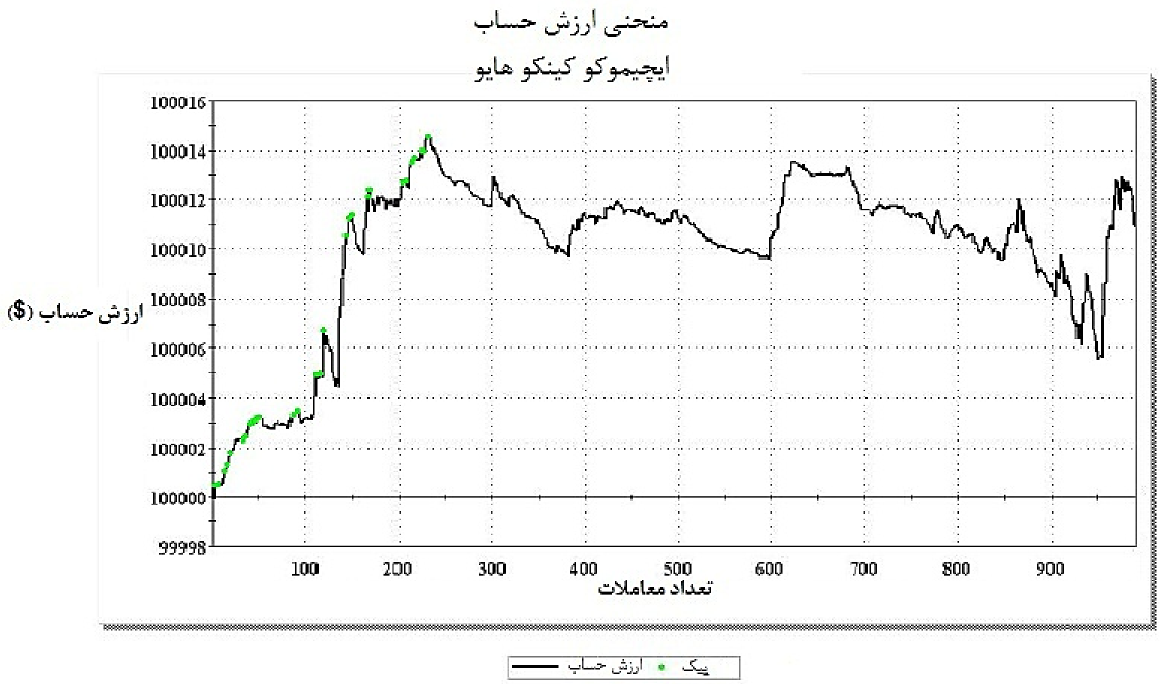


شکل ۸۴ روند قیمت FX.LNG از ۱۹۷۵/۰۲/۱۳ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز طلا (GC.LNG)



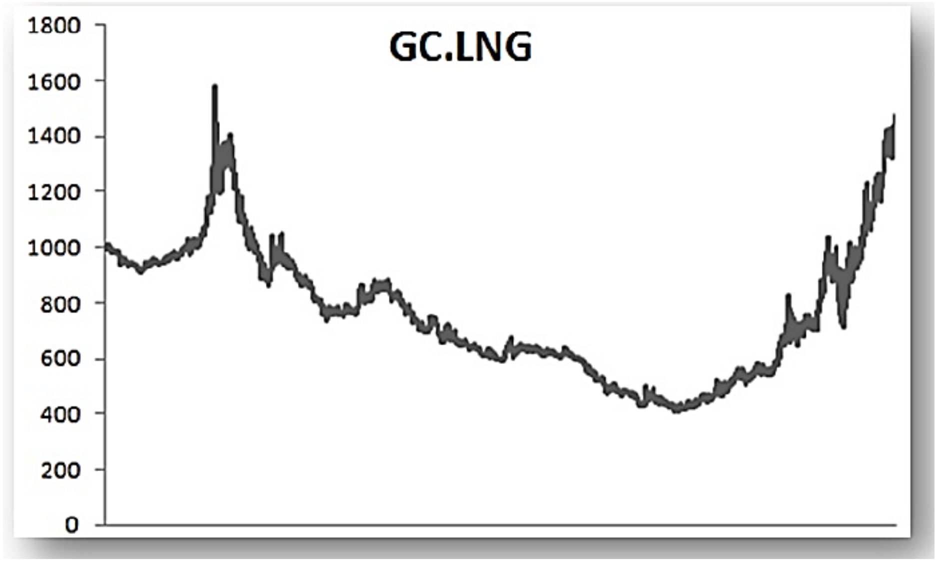
شکل ۸۵ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از می تا دسامبر ۲۰۱۰



شکل ۸٦ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷۵/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۹۹۱
نرخ موفقیت	%۴۰٫۲۶
میانگین سود و زیان	۱٫۸۰
شاخص سودآوری	۱٫۲۱

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت افزایش می یابد، سپس شاهد افت طولانی است و دوباره در انتها افزایش می یابد. نرخ موفقیت بالاتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. اما هیچ کدام به ۲٫۰ نمی رسند.

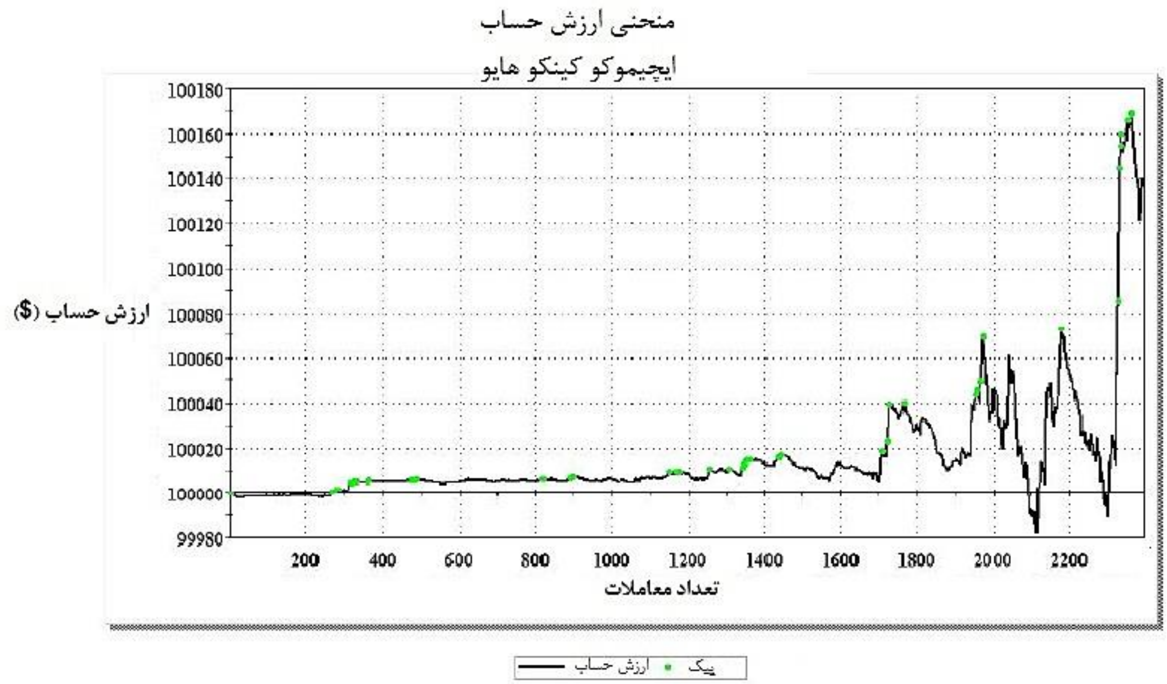


شکل ۸۷ روند قیمت GC.LNG از ۱۹۷۵/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

Dow Jones Industrial Index (INDU) [شاخص صنعتی داو جونز]



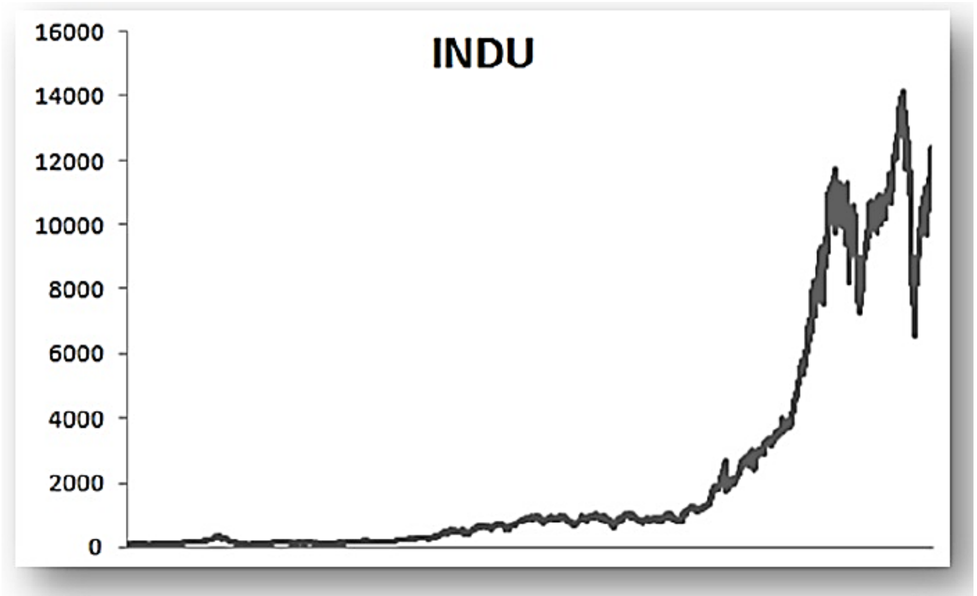
شکل ۸۸ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژانویه تا ژوئیه ۲۰۰۹



شکل ۸۹ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۰۱/۰۱/۳۱ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۰۹۳
نرخ موفقیت	%۴۲٫۰۲
میانگین سود و زیان	۱٫۶۸
شاخص سودآوری	۱٫۲۲

منحنی ارزش حساب شاهد حرکات یک طرفه بلند با به دنبال آن حرکات رو به بالا و رو به پایین است. روند قیمت شاهد حرکات یک طرفه بلند و به دنبال آن حرکات رو به بالا و رو به پایین است. نرخ موفقیت بالاتر از %۴۰ و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. اما هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

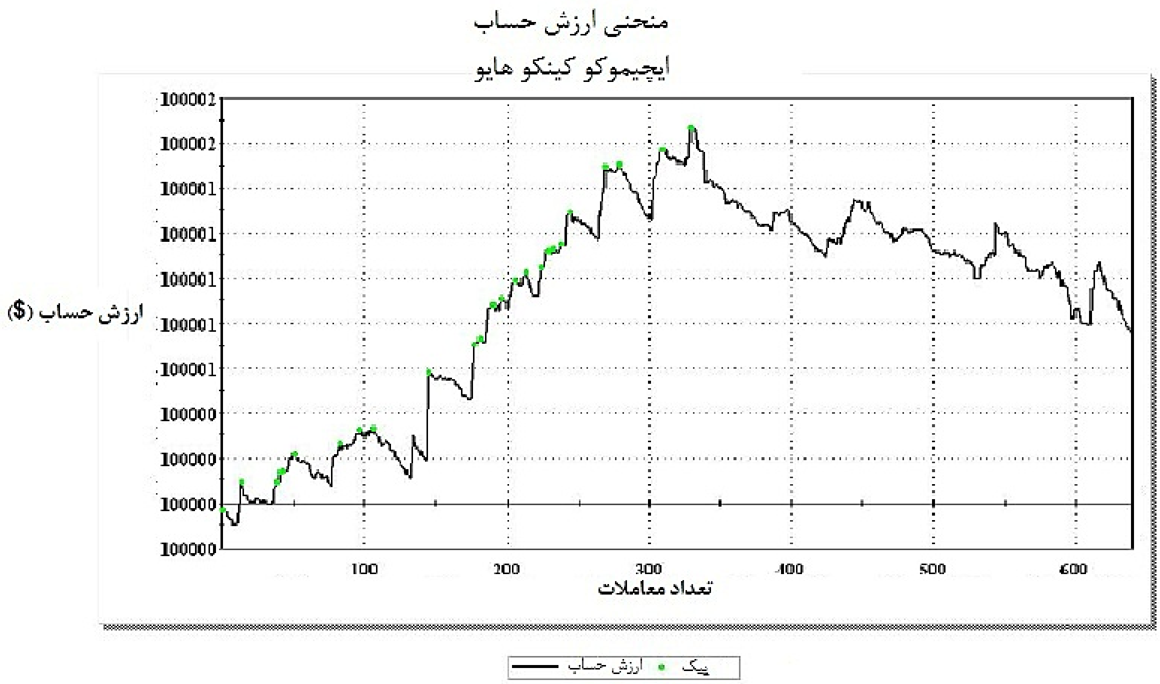


شکل ۹۰ روند قیمت INDU از ۱۹۰۱/۰۱/۳۱ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز ین ژاپن Jap Yen (JN.NON)



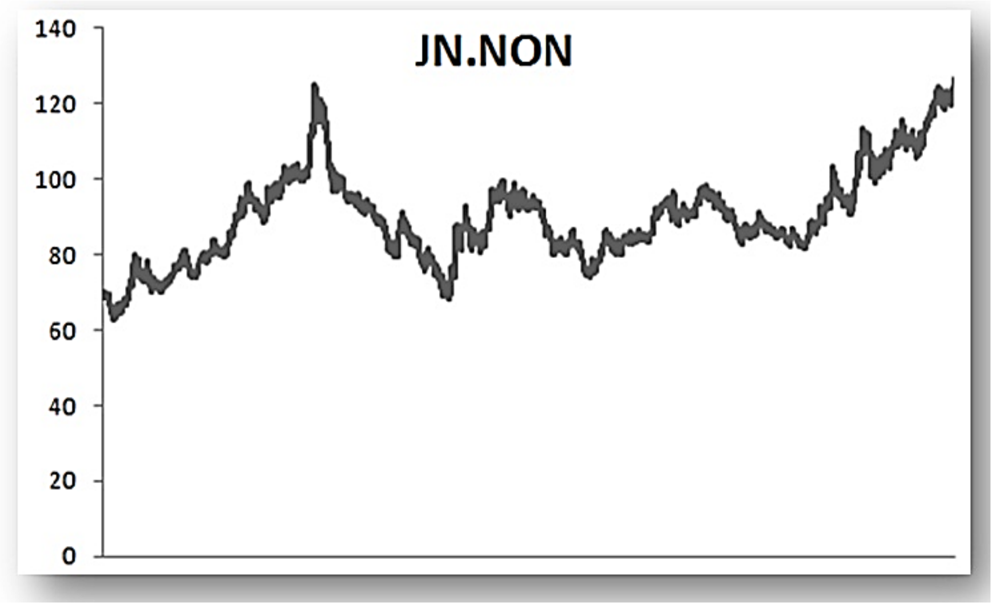
شکل ۹۱ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از اوت ۲۰۰۹ تا فوریه ۲۰۱۰



شکل ۹۲ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۹۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲۴

تعداد معاملات	۶۴۰
نرخ موفقیت	%۳۹٫۰۶
میانگین سود و زیان	۱٫۸۴
شاخص سودآوری	۱٫۱۸

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین تکرار شونده است. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. هیچ کدام از ۲٫۰ بزرگ تر نیستند.

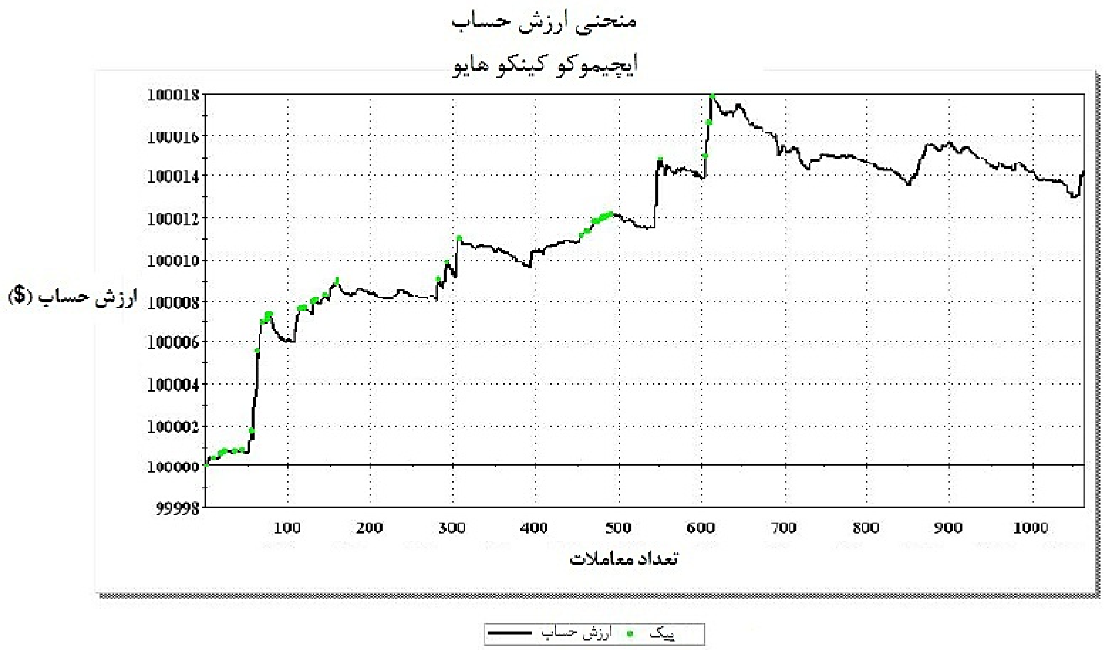


شکل ۹۳ روند قیمت JN.NON از ۱۹۹۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۳/۲٤

فیوچرز قهوه (KC.LNG)



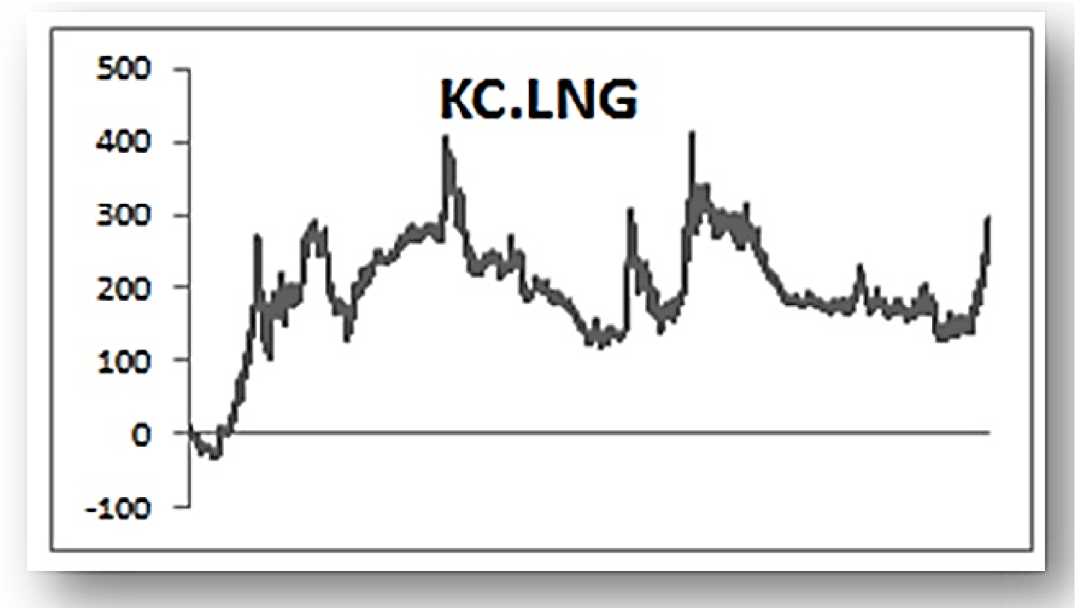
شکل ۹۴ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از سپتامبر ۲۰۰۹ تا فوریه ۲۰۱۰



شکل ۹۵ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۰۶۴
نرخ موفقیت	%۴۱٫۶۴
میانگین سود و زیان	۲٫۱۰
شاخص سودآوری	۱٫۵۰

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین تکرار شونده است. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بالقوه برای KC.LNG باشد.

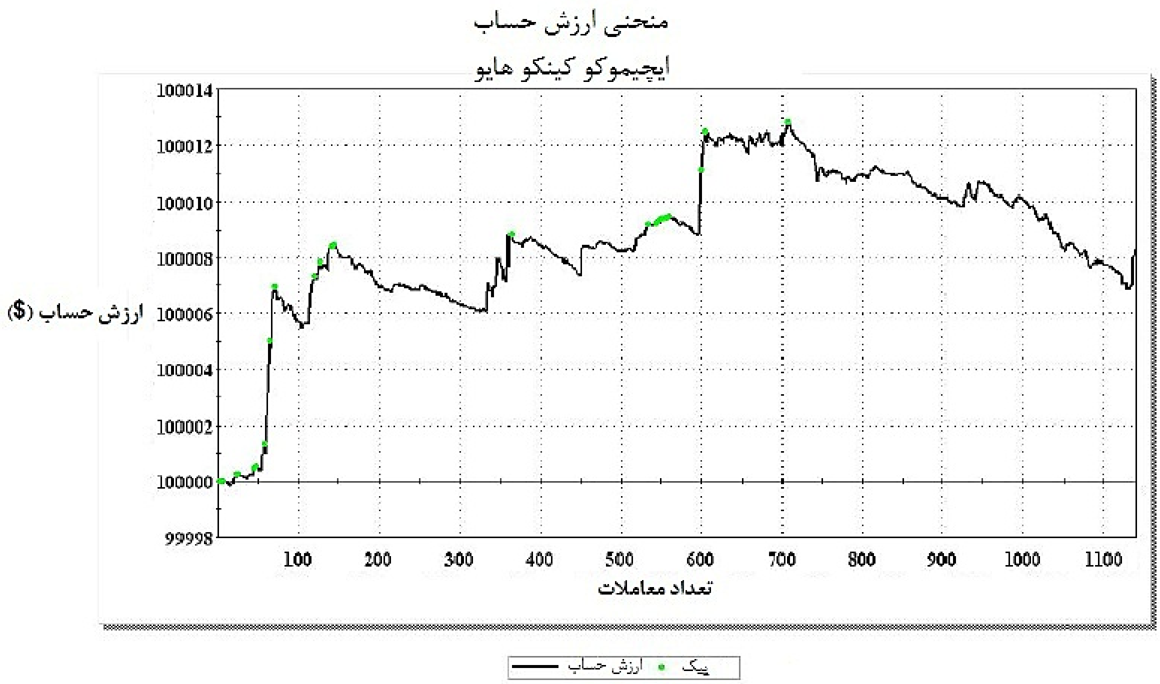


شکل ۹٦ روند قیمت KC.LNG از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز قهوه (KC.NON)



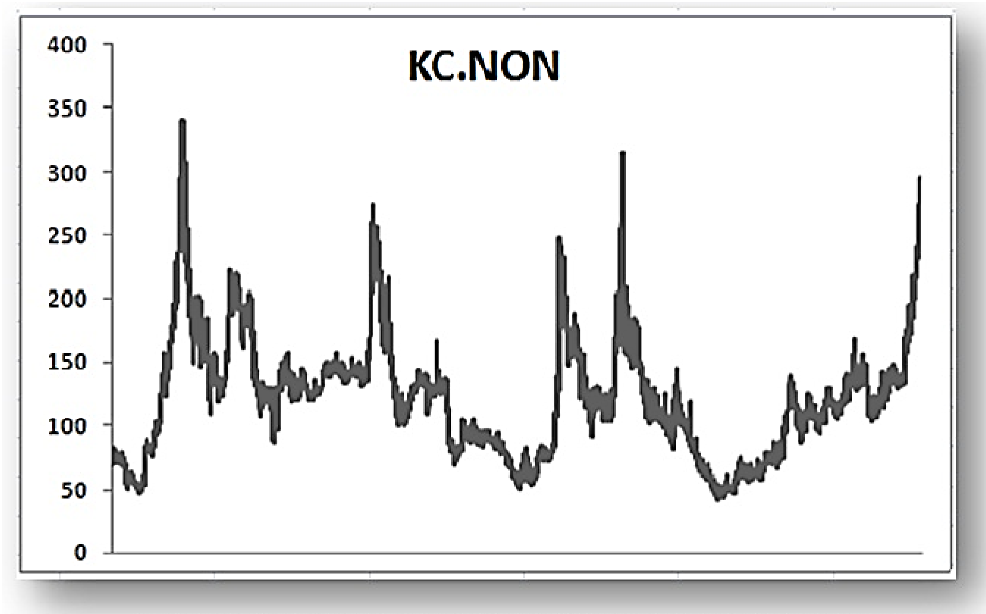
شکل ۹۷ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از سپتامبر ۲۰۱۰ تا مارس ۲۰۱۱



شکل ۹۸ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۱۴۰
نرخ موفقیت	%۳۸٫۶۰
میانگین سود و زیان	۲٫۰۳
شاخص سودآوری	۱٫۲۷

منحنی ارزش حساب شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین است، اما افزایش پیوسته ندارد. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین قوی است. نرخ موفقیت کمتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای KC.NON باشد.

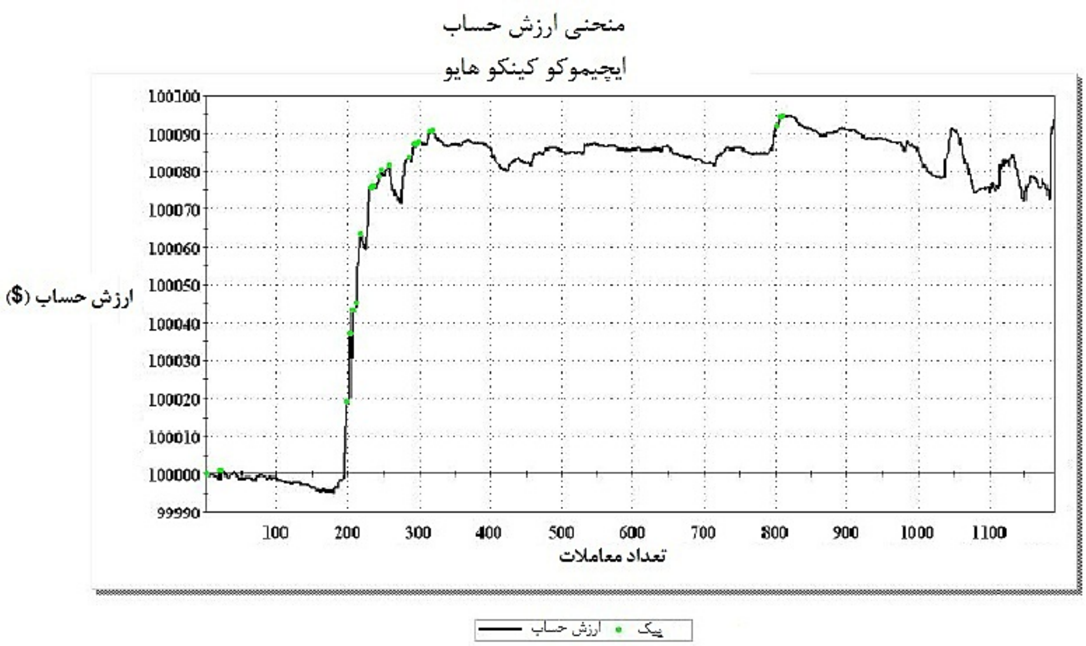


شکل ۹۹ روند قیمت KC.NON از ۱۹۷٤/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز نقره (SL.LNG)



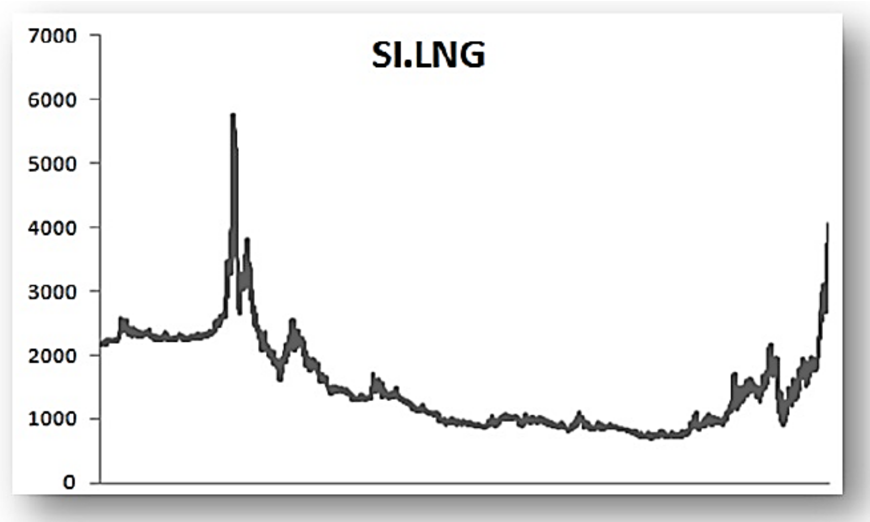
شکل ۱۰۰ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از نوامبر ۲۰۰۹ تا می ۲۰۱۰



شکل ۱۰۱ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۱۹۱
نرخ موفقیت	%۴۱٫۳۱
میانگین سود و زیان	۲٫۲۴
شاخص سودآوری	۱٫۵۸

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت ابتدا در جهت های یک طرفه حرکت می کند و سپس افزایش می یابد. در ادامه قیمت دوباره افت شدید دارد و سپس به حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی تبدیل می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV نیز از ۲٫۰ بزرگ تر است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی قابل قبولی برای SL.LNG باشد.

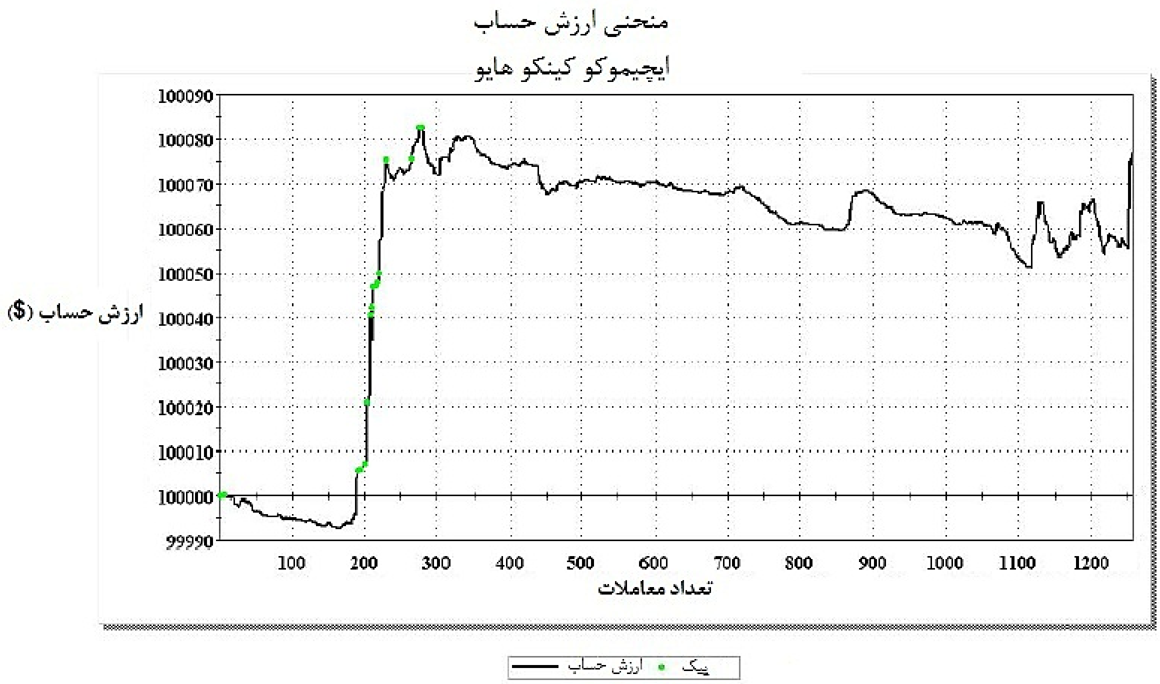


شکل ۱۰۲ روند قیمت SL.LNG از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

فیوچرز نقره (SL.NON)



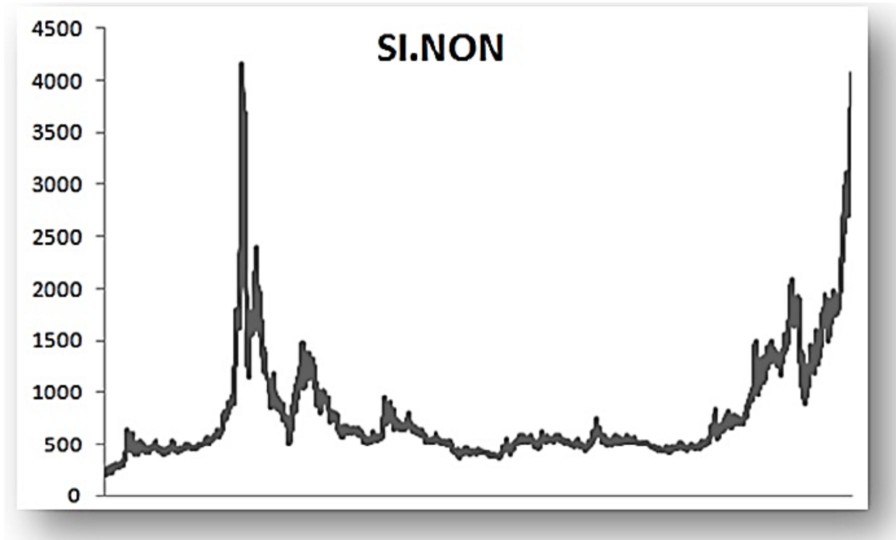
شکل ۱۰۳ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از نوامبر ۲۰۰۹ تا می ۲۰۱۰



شکل ۱۰٤ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۲۷۵
نرخ موفقیت	%۴۰٫۱۸
میانگی سود و زیان	۲٫۱۹
شاخص سودآوری	۱٫۴۷

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت شاهد حرکات قوی رو به بالا و رو به پایین است. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV نیز از ۲٫۰ بزرگ تر است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بالقوه برای SL.NON باشد.

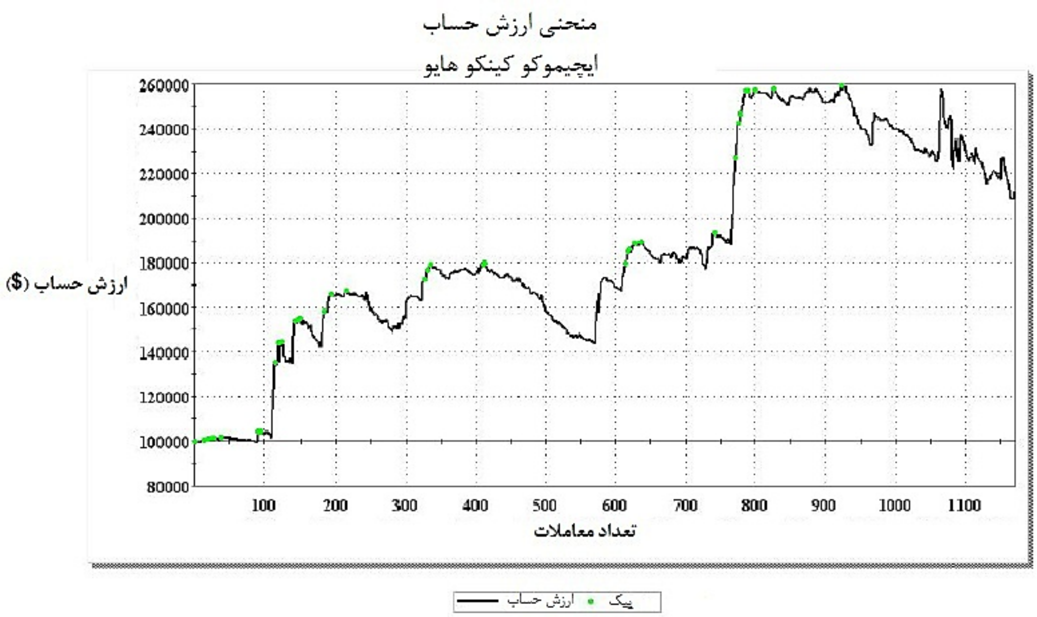


شکل ۱۰۵ روند قیمت SL.NON از ۱۹۷۳/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

فیوچرز گندم (W-.LNG)



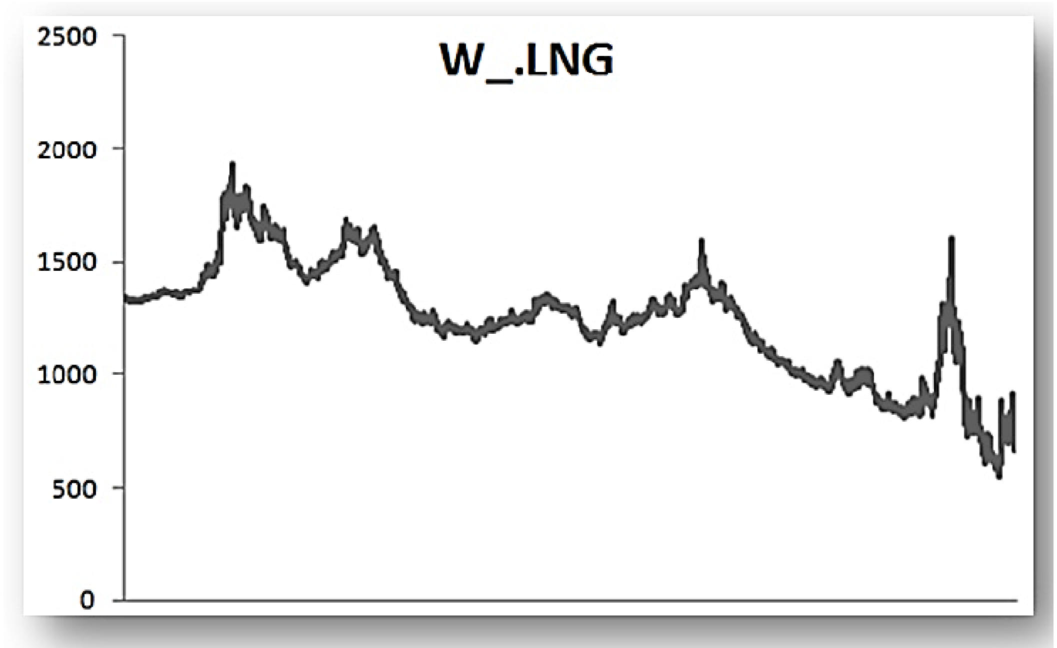
شکل ۱۰٦ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از اکتبر ۲۰۰۹ تا ژانویه۲۰۱۰



شکل ۱۰۷ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹۶۹/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۱۷۲
نرخ موفقیت	%۴۰٫۰۲
میانگی سود و زیان	۱٫۹۰
شاخص سودآوری	۱٫۲۷

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین تکرار شونده است. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. با این حال هیچ کدام بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند.



شکل ۱۰۸ روند قیمت W-.LNG از ۱۹۶۹/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

جدول ذیل فهرستی از بیست و هشت بازار و نتایج متناظر آنها برای اجرای IKHS3 ارائه می کند. قیمت DAX، قیمت نقره، فیوچرز پیوسته با شکاف نفت و فیوچرز نقره و فیوچرز CRB، فیوچرز قهوه، فیوچرز پیوسته با شکاف قهوه، فیوچرز نقره، فیوچرز پیوسته با شکاف نقره نتایج مطلوبی به دست آورد. دوازده بازار دیگر از مجموع بیست و هشت بازار نیز به نتایج مطلوب نزدیک هستند. با نگاهی به دیگر بازارها نیز نتیجه می گیریم که IKHS3 نباید به صورت نسخه اصلی آن به کار گرفته شود.

داده‌ها	تعداد معاملات	نرخ موفقیت	میانگین سود و زیان	شاخص سودآوری
Coffee$	۸۷۲	۴۸,۹۷	۱,۴۸	۱,۴۲
Cotton$	۱۲۰۳	۴۳,۰۶	۱,۸۸	۱,۴۲
DAX$	۴۷۵	۴۰,۲۱	۲,۰۹	۱,۴۱
Gold$	۱۱۷۳	۴۰,۷۵	۱,۶۱	۱,۱۱
Silver$	۱۲۸۱	۳۹,۴۲	۲,۲۴	۱,۴۶
SPX$	۲۰۹۵	۴۱,۱۹	۱,۷۴	۱,۲۲
Wheat$	۱۱۵۹	۳۸,۰۵	۱,۳۵	۱,۸۳
WTCRUDE$	۸۷۵	۴۱,۱۴	۱,۷۱	۱,۱۹
AX.LNG	۳۶۰	۳۸,۶۱	۱,۹۴	۱,۲۲
AX.NON	۳۴۳	۳۹,۶۵	۱,۵۹	۱,۰۵
CL.LNG	۶۸۲	۴۲,۳۸	۲,۱۶	۱,۵۹
CL.NON	۷۹۱	۳۸,۴۳	۲,۳۳	۱,۴۶
CR.LNG	۸۳۶	۳۸,۰۴	۲,۰۵	۱,۲۶
CT.NON	۱۱۱۱	۳۸,۷	۱,۷۵	۱,۱۱
EURUSD	۳۵۱	۴۷,۰۱	۱,۱۷	۱,۰۳
FX.LNG	۹۱۳	۴۳,۰۴	۱,۸۲	۱,۸۳
FX.NON	۱۰۲۲	۴۹,۴۱	۱,۳	۱,۲۷
GC.LNG	۹۹۱	۴۰,۲۶	۱,۸	۱,۲۱
GC.NON	۱۰۹۳	۴۲,۵۴	۱,۵۴	۱,۱۴
INDU	۲۳۹۴	۴۲,۰۲	۱,۶۸	۱,۲۲
JN.NON	۶۴۰	۳۹,۰۶	۱,۸۴	۱,۱۸
KC.LNG	۱۰۶۴	۴۱,۶۴	۲,۱	۱,۵
KC.NON	۱۱۴۰	۳۸,۶	۲,۰۳	۱,۲۷
SI.LNG	۱۱۹۱	۴۱,۳۱	۲,۲۴	۱,۵۸
SI.NON	۱۲۵۷	۴۰,۱۸	۲,۱۹	۱,۴۷
USDJPY	۴۴۳	۳۴,۹۹	۱,۶۳	۰,۸۸
W_.LNG	۱۱۷۲	۴۰,۰۲	۱,۹	۱,۲۷
W_.NON	۱۲۶۰	۳۹,۳۷	۱,۴۴	۰,۹۳

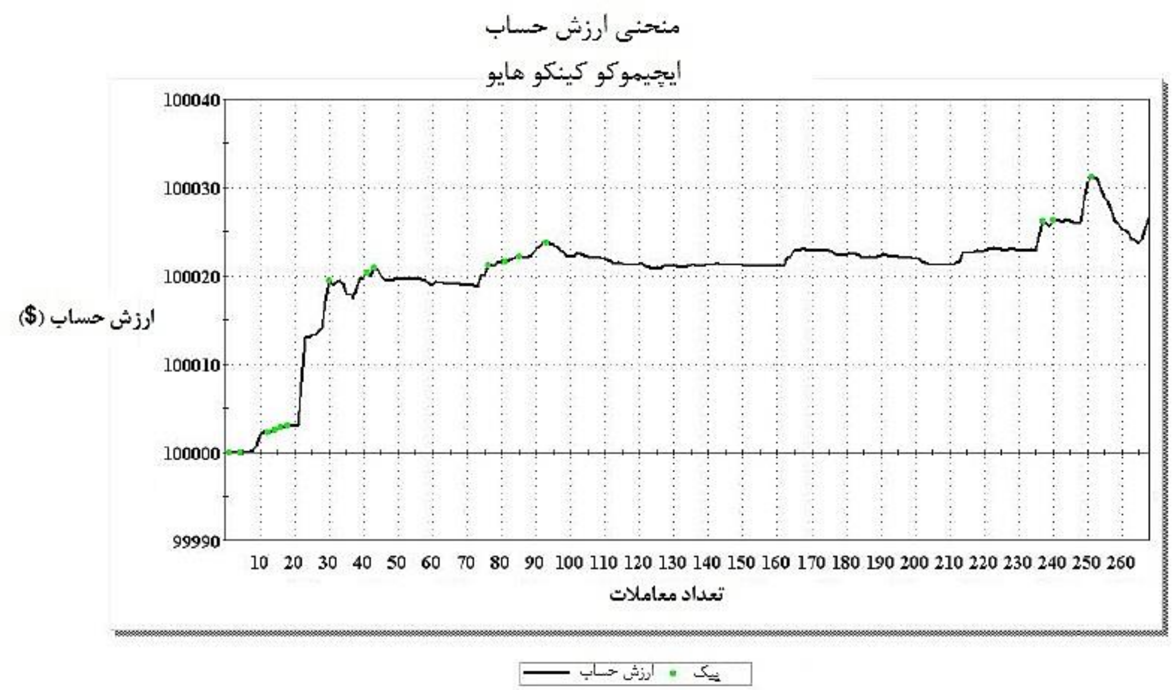
جدول ۳ ۲۸ بازار و IKHS3 متناظر

٤٫٢. آزمون های مبتنی بر نمودارهای هفتگی

طلا ($Gold)



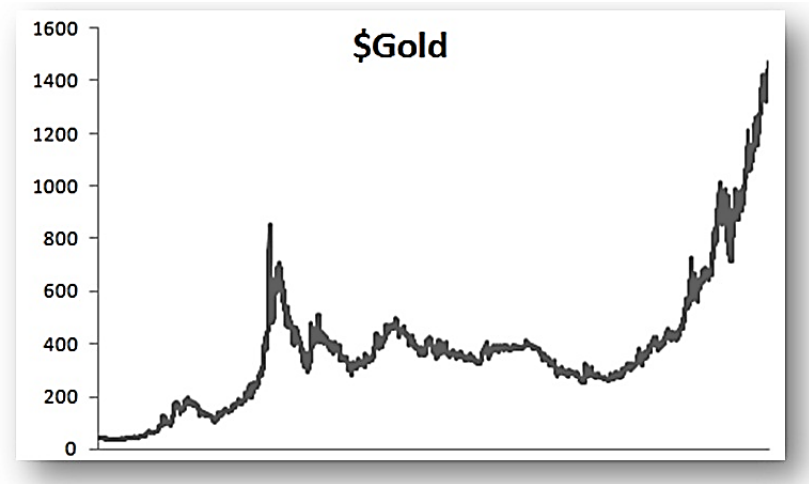
شکل ۱۰۹ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، و خنثی از ژوئن ۲۰۰۳ تا دسامبر ۲۰۰٤



شکل ۱۱۰ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، و خنثی از ۱۹۶۹/۰۶/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

تعداد معاملات	۲۶۸
نرخ موفقیت	%۴۷٫۰۱
میانگین سود و زیان	۲٫۳۱
شاخص سودآوری	۲٫۰۵

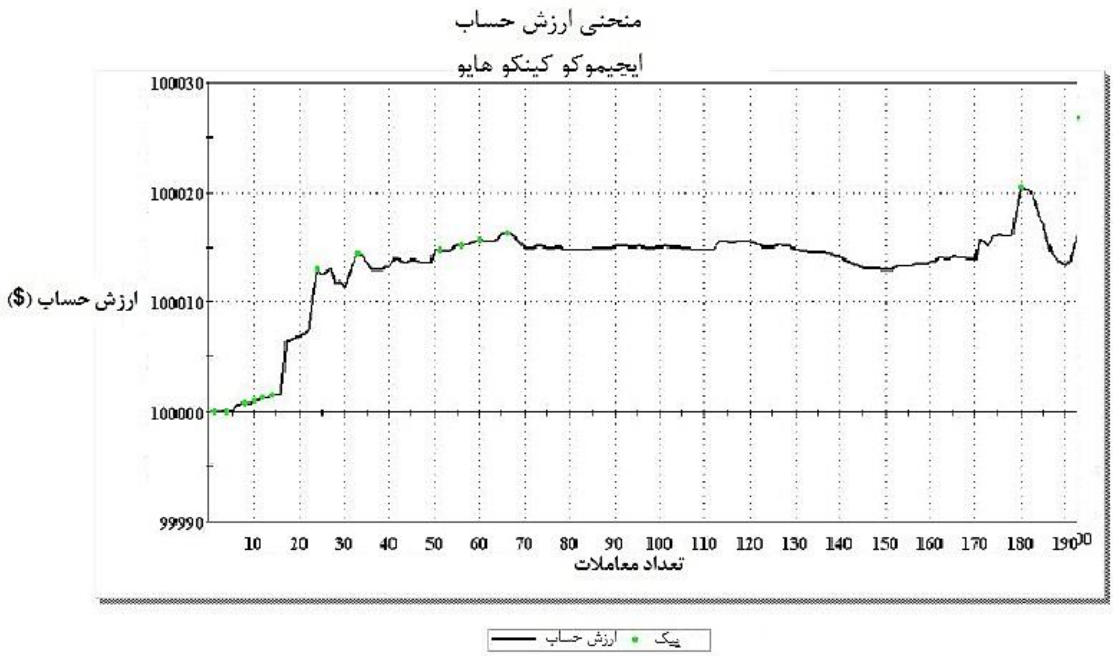
منحنی ارزش حساب به طور پیوسته افزایش نمی یابد. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین است. و رو به انتها افزایش قوی دارد. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۵% و DGV و PF بزرگ تر از ۲٫۰ است. با این حال هیچ کدام بزرگ تر از ۲٫۰ نیستند. بنابراین IKHS2 می تواند استراتژی مطلوبی برای قیمت طلا بر مبنای نمودارهای هفتگی باشد.



شکل ١١١ روند قیمت $Gold از ١٩٦٩/٠٦/٠٢ تا ٢٠١١/٠٤/٠٨



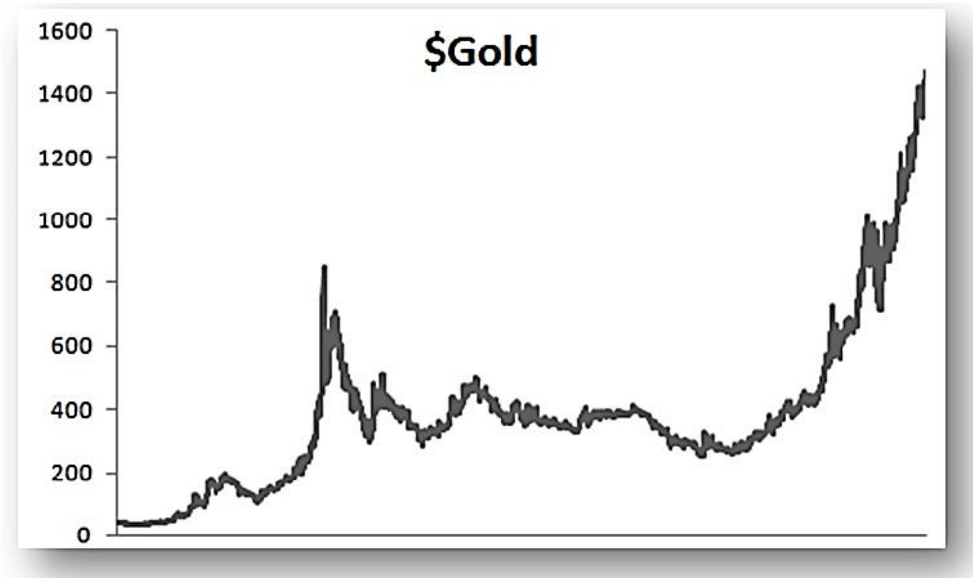
شکل ١١٢ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از ژوئن ٢٠٠٣ تا دسامبر ٢٠٠٤



شکل ۱۱۳ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال قوی، از ۱۹٦۹/۰٦/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۹۳
نرخ موفقیت	۴۳٫۰۱%
میانگین سود و زیان	۲٫۲۶
شاخص سودآوری	۱٫۷۱

منحنی ارزش حساب بهینه نیست. روند قیمت شاهد حرکات رو به بالا و رو به پایین است. و رو به انتها افزایش قوی دارد. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ است. DGV از ۲٫۰ بزرگ تر است. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت طلا بر مبنای نمودارهای هفتگی باشد.

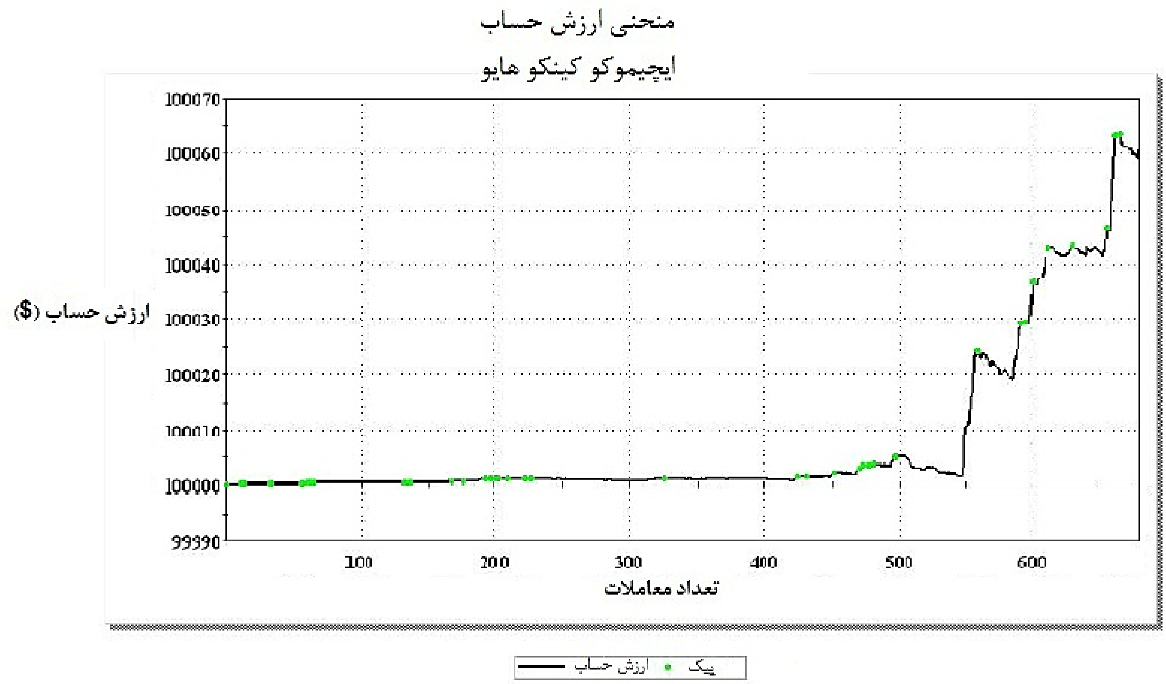


شکل ۱۱٤ روند قیمت $Gold از ۱۹۶۹/۶/۲ تا ۲۰۱۱/۴/۸

طلا($Gold)



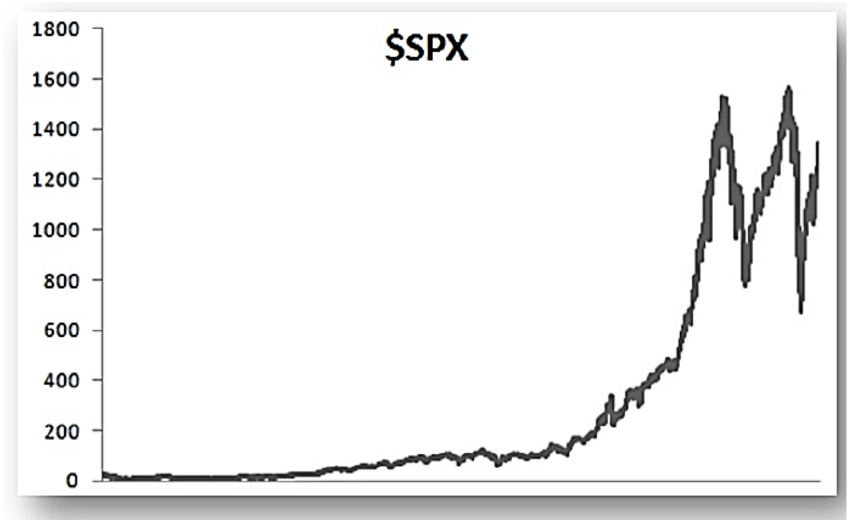
شکل ۱۱۵ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی و ضعیف از آوریل ۲۰۰۸ تا اکتبر ۲۰۱۰



شکل ۱۱٦ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) منحنی ارزش حساب با سگینال های قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۶۷۹
نرخ موفقیت	%۵۱٫۴۰
میانگین سود و زیان	۲٫۸۹
شاخص سودآوری	۳٫۰۶

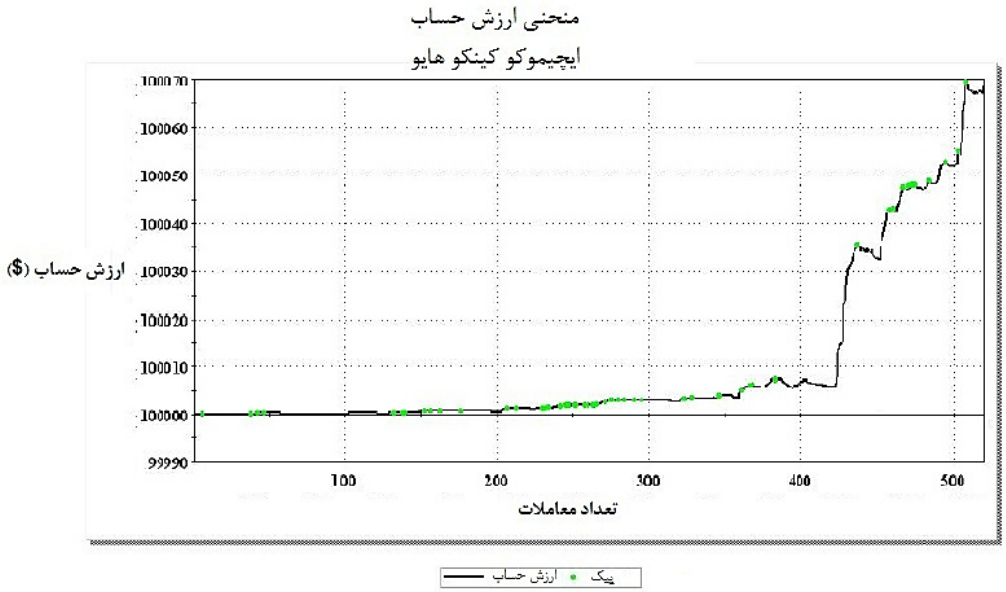
پیشرفت منحنی ارزش حساب شاهد صعود پیوسته نیست. در روند قیمت حرکات یک طرفه با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی مشاهده می شود. که در نهایت به افزایش و به دنبال آن افزایش و کاهش مجدد تبدیل می شود. نرخ موفقیت بزرگتر از ۵۰% و DGV و PF کاملا بزرگتر از ۲٫۰ هستند. بنابراین IKHS1 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودار هفتگی باشد.



شکل ۱۱۷ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸



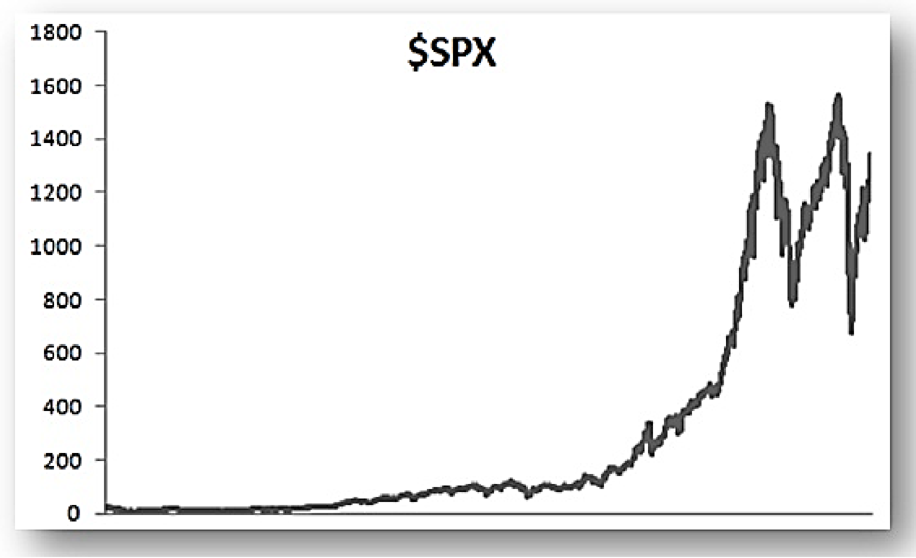
شکل ۱۱۸ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی و ضعیف از آوریل ۲۰۰۸ تا اکتبر ۲۰۱۰



شکل ۱۱۹ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) منحنی ارزش حساب با سگینال های قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۵۲۱
نرخ موفقیت	%۵۱٫۶۳
میانگین سود و زیان	۳٫۹۸
شاخص سودآوری	۴٫۲۵

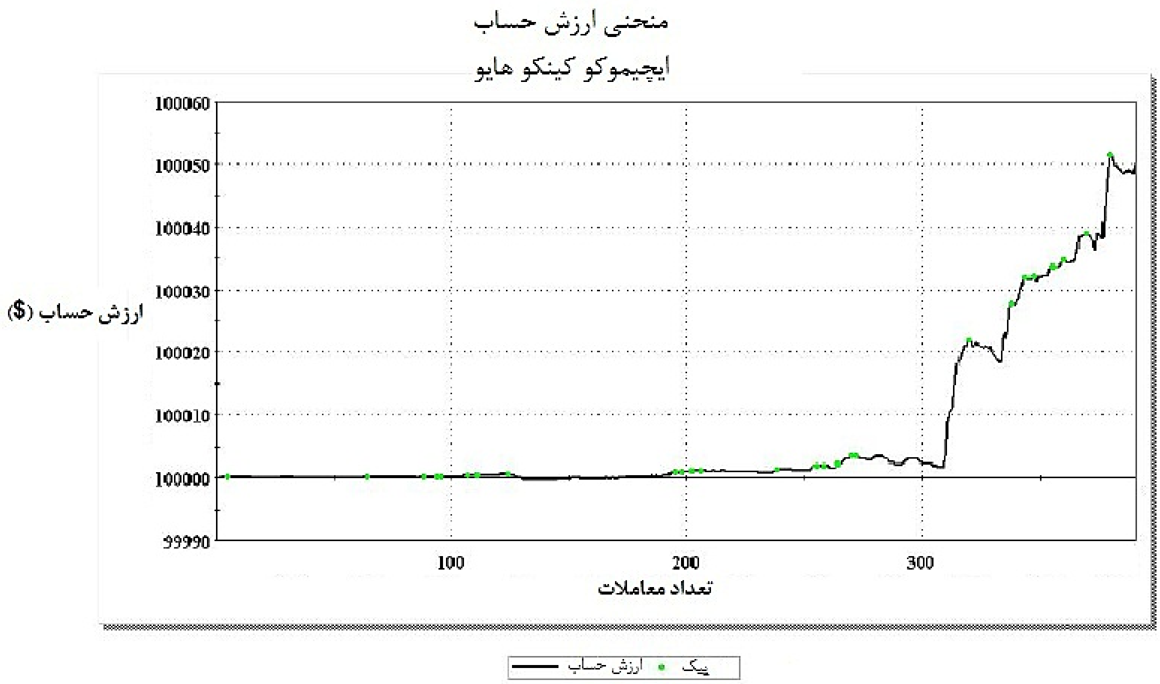
پیشرفت منحنی ارزش حساب شاهد صعود پیوسته نیست. در روند قیمت حرکات یک طرفه با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی مشاهده می شود. که در نهایت به افزایش و به دنبال آن افزایش و کاهش مجدد تبدیل می شود. نرخ موفقیت بزرگتر از ۵۰% و DGV و PF کاملا بزرگتر از ۲٫۰ هستند. بنابراین IKHS1 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودار هفتگی باشد.



شکل ۱۲۰ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸



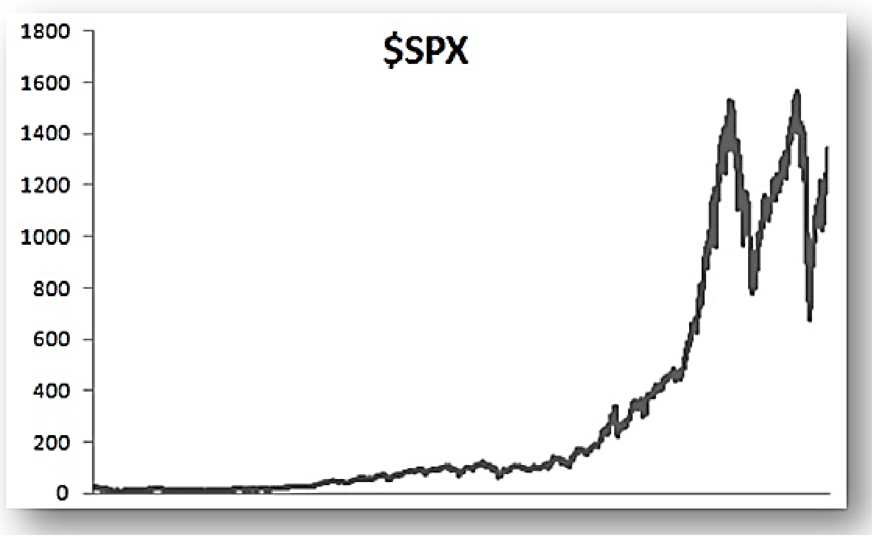
شکل ۱۲۱ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، از آوریل ۲۰۰۸ تا اکتبر ۲۰۱۰



شکل ۱۲۲ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) منحنی ارزش حساب با سگینال های قوی، خنثی و ضعیف از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۳۹۰
نرخ موفقیت	%۴۶٫۱۵
میانگین سود و زیان	۳٫۸۱
شاخص سودآوری	۳٫۲۷

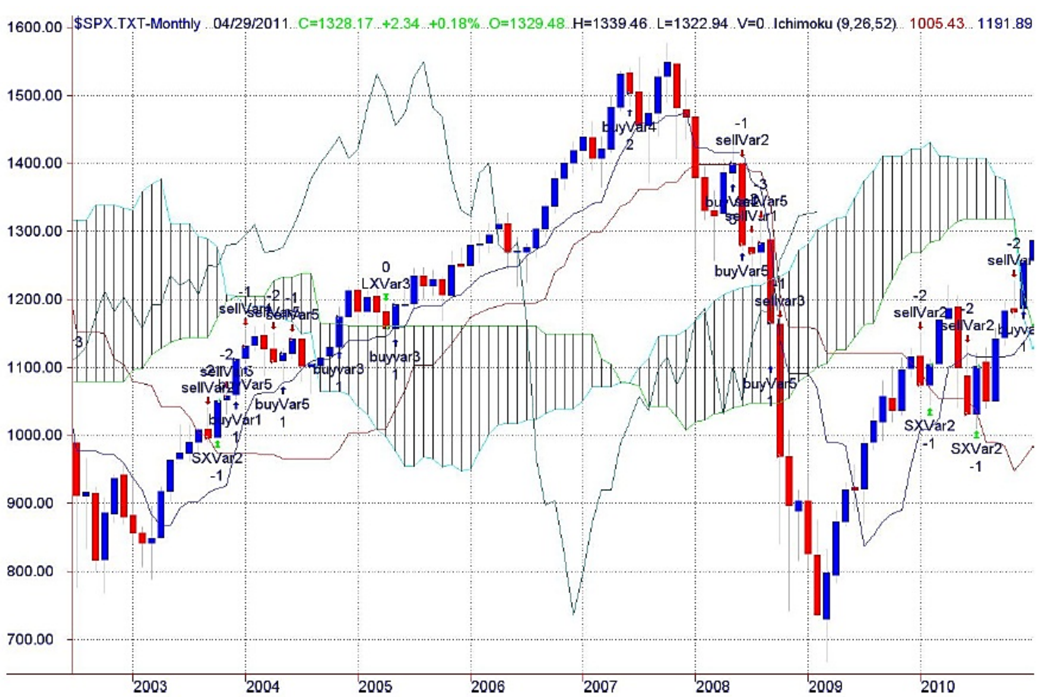
پیشرفت منحنی ارزش حساب شاهد صعود پیوسته نیست. در روند قیمت حرکات یک طرفه با حرکات روبه بالا و رو به پایین جزئی مشاهده می شود. که درنهایت به افزایش و به دنبال آن افزایش و کاهش مجدد تبدیل می شود. نرخ موفقیت بزرگتر از ۴۵% و DGV و PF کاملا بزرگتر از ۲٫۰ هستند. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودار هفتگی باشد



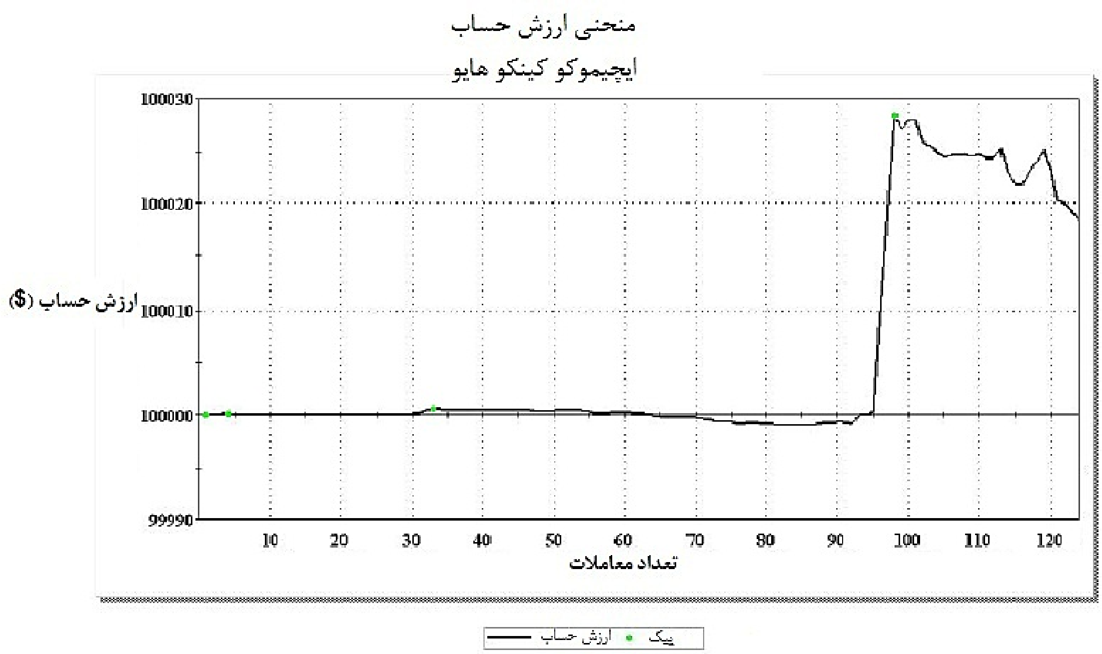
شکل ۱۲۳ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

٤٫۳. آزمون های مبتنی بر نمودارهای ماهانه

($SPX) S&P 500



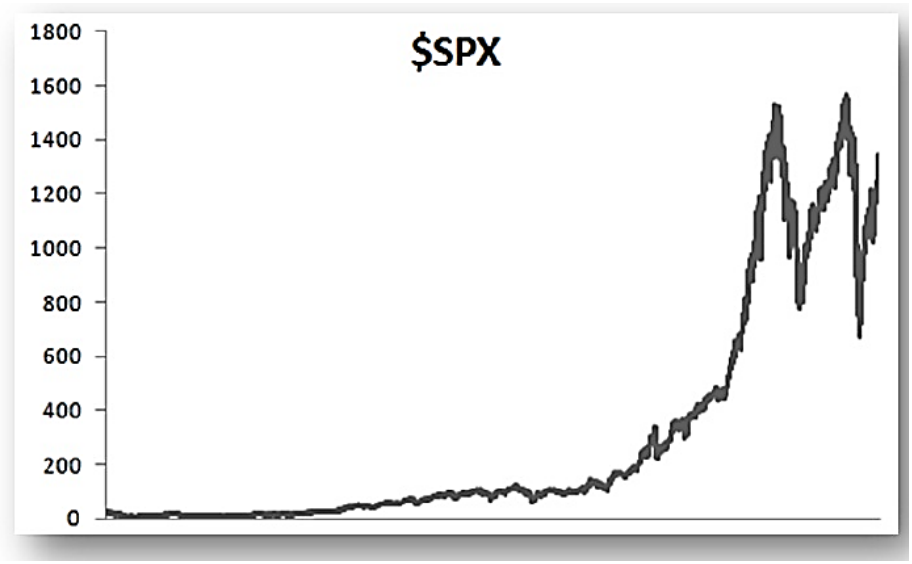
شکل ۱۲٤ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، خنثی، و ضعیف از ۲۰۰۲ تا ۲۰۱۱



شکل ۱۲۵ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال‌های قوی، خنثی، و ضعیف از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۱۲۴
نرخ موفقیت	%۴۵٫۹۷
میانگین سود و زیان	۲٫۳۶
شاخص سودآوری	۲٫۰۱

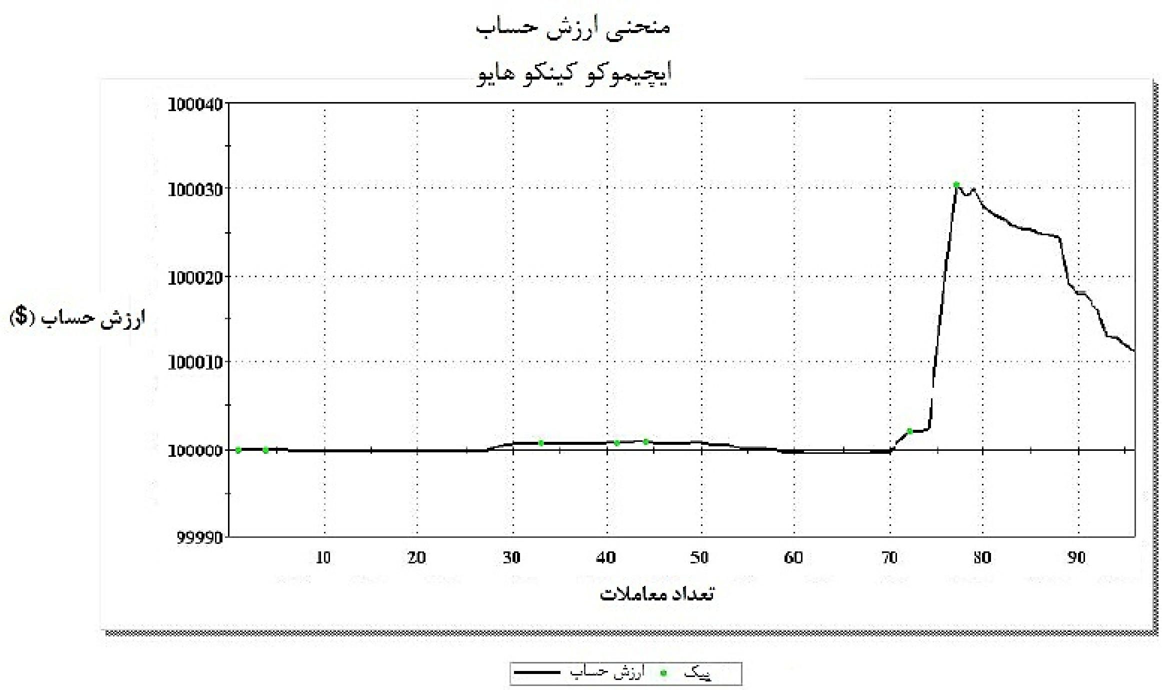
پیشرفت منحنی ارزش حساب افزایش پیوسته نشان نمی دهد. روند قیمت شاهد حرکات یک طرفه همراه با حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی است، که در انتها به افزایش قوی و سپس حرکات رو به بالا و رو به پایین ختم می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۵% و DGV و PF به خوبی بزرگ تر از ۲٫۰ هستند. بنابراین IKHS1 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودارهای ماهانه باشد.



شکل ۱۲٦ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸



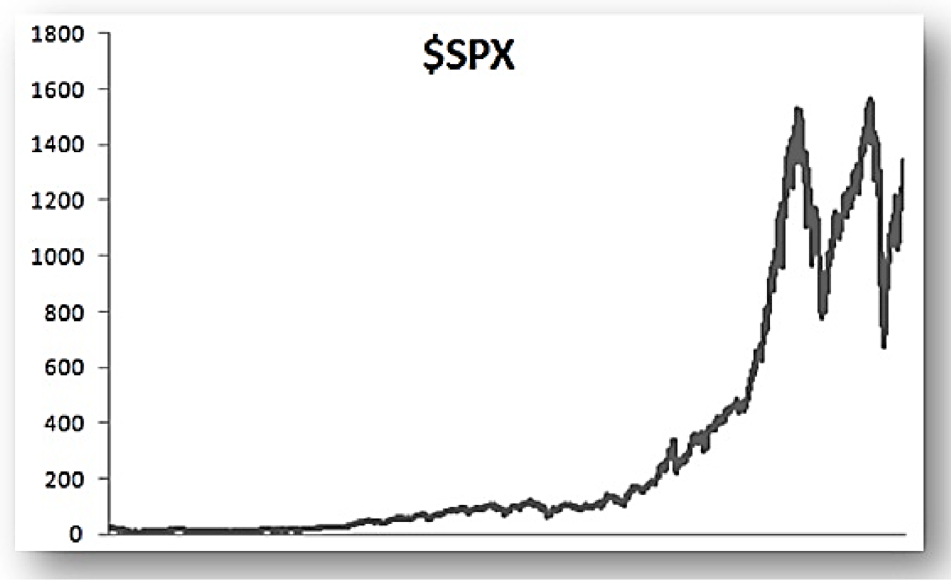
شکل ۱۲۷ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی، و خنثی، از ۲۰۰۲ تا ۲۰۱۱



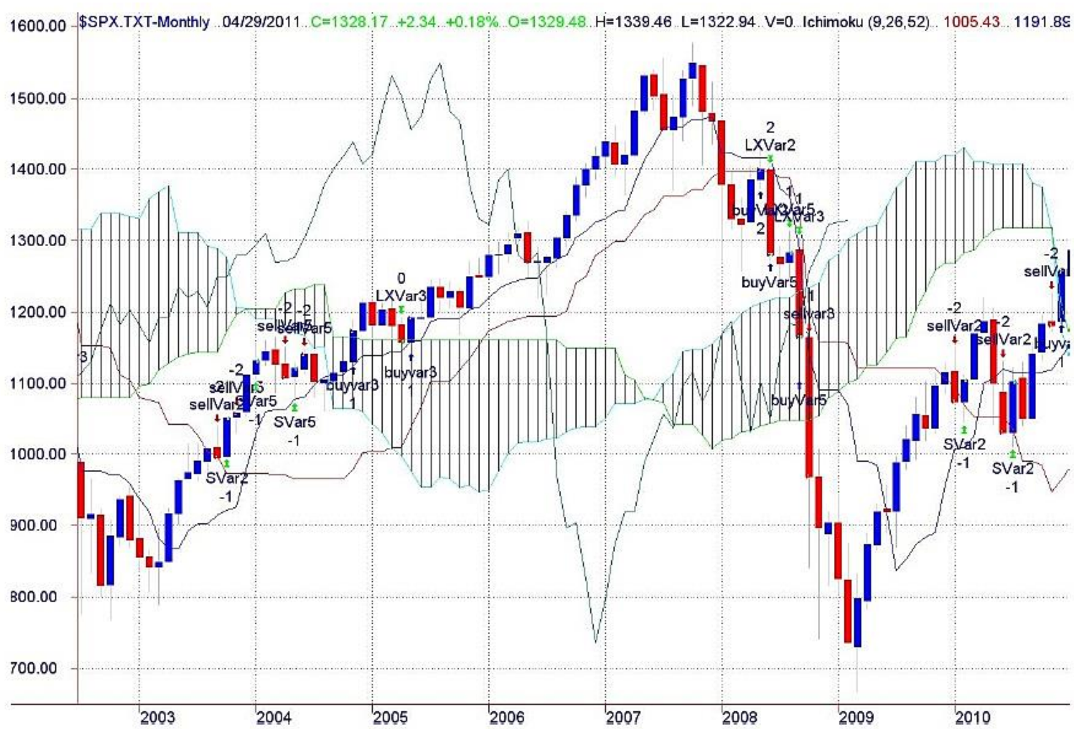
شکل ۱۲۸ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال‌های قوی، و خنثی، از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۹۶
نرخ موفقیت	%۴۱٫۹۷
میانگین سود و زیان	۲٫۱۱
شاخص سودآوری	۱٫۵۱

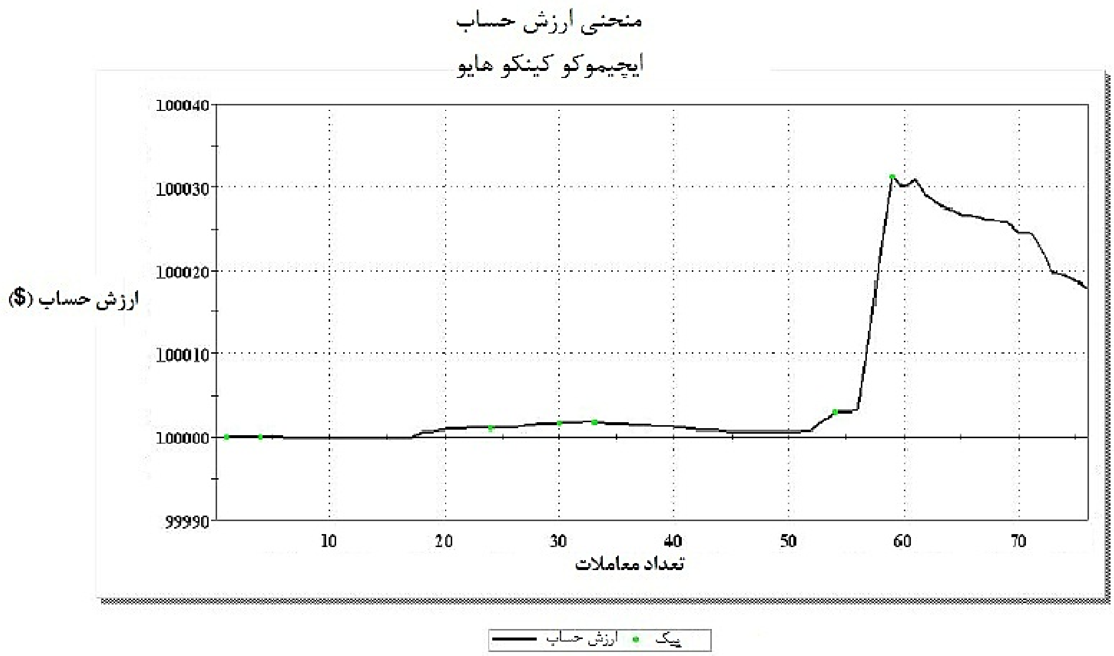
پیشرفت منحنی ارزش حساب افزایش پیوسته نشان نمی دهد. روند قیمت شاهد حرکات یک طرفه همراه با حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی است، که در انتها به افزایش قوی و سپس حرکات رو به بالا و رو به پایین ختم می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۱٫۰ هستند. DGV بزرگ تر از ۲٫۰ است، بنابراین IKHS2 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودارهای ماهانه باشد.



شکل ۱۲۹ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸



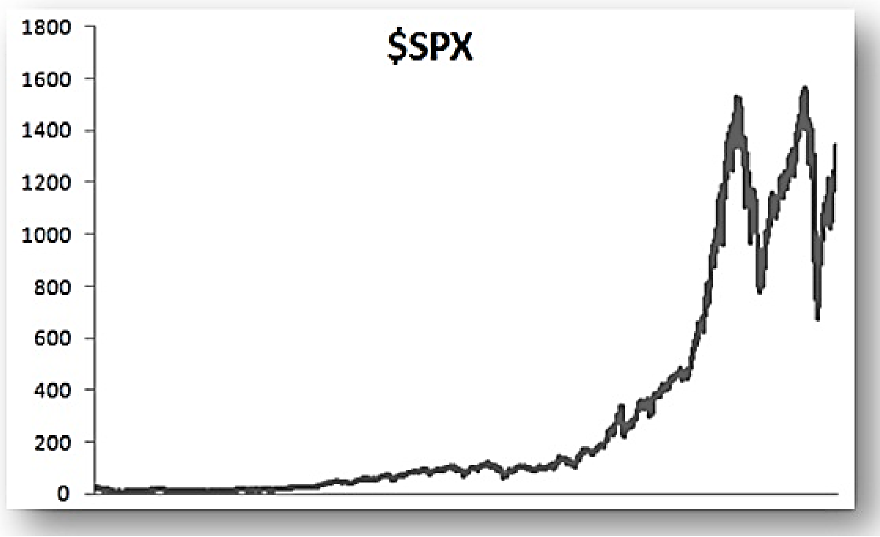
شکل ۱۳۰ Ichimoku Kinko Hyo (ایچیموکو کینکو هایو) با سیگنال‌های قوی ، از ۲۰۰۲ تا ۲۰۱۱



شکل ۱۳۱ Ichimoku Kinko Hyo منحنی ارزش حساب با سیگنال‌های قوی ، از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰٤/۰۸

تعداد معاملات	۷۶
نرخ موفقیت	%۴۳٫۴۲
میانگین سود و زیان	۲٫۷۷
شاخص سودآوری	۲٫۱۳

پیشرفت منحنی ارزش حساب افزایش پیوسته نشان نمی دهد. روند قیمت شاهد حرکات یک طرفه همراه با حرکات رو به بالا و رو به پایین جزئی است، که در انتها به افزایش قوی و سپس حرکات رو به بالا و رو به پایین ختم می شود. نرخ موفقیت بیشتر از ۴۰% و DGV و PF بزرگ تر از ۲٫۰ هستند. بنابراین IKHS3 می تواند استراتژی بسیار مطلوبی برای قیمت S&P 500 بر مبنای نمودارهای ماهانه باشد.



شکل ۱۳۲ روند قیمت S&P 500 از ۱۹۳۰/۰۱/۰۲ تا ۲۰۱۱/۰۴/۰۸

۵. نتیجه‌گیری و چشم‌انداز

Ichimoku Kinko Hyo استراتژی جامعی است که در این مطالعه با جزییات بیشتری توضیح داده شده است. این استراتژی از پنج اندیکاتور و ابر تشکیل شده است. به همین دلیل، استراتژی معرفی شده به‌عنوان نمودار ابر نیز شناخته می‌شود. این استراتژی در بیست‌وهشت بازار مختلف بر اساس نمودار روزانه آزمایش شد. علاوه بر این، دو نسخه متفاوت از این استراتژی در بازارهای اشاره‌شده اجرا شد. در نسخه اصلی، نتایج کاملاً مطلوب کم بود، و تا حدی نتایج نسبتاً مطلوب وجود داشت. در اولین نسخه اصلاح‌شده استراتژی IKH2 موارد بیشتری نتایج مطلوب مشاهده شد. در این نسخه تنها سیگنال‌های قوی ارزیابی شدند، در این حالت نتایج به میزان قابل‌توجهی مطلوب‌تر بودند. بازارهای قهوه، فیوچرز DAX، فیوچرز Euro/Dollar، فیوچرز طلا، فیوچرز Euro/Dollar، Dollar/Yen و گندم با اجرای این سه نسخه از استراتژی به نتایج مطلوبی منجر نشد. آزمایش‌های مربوط به طلا، S&P 500 و نفت بر اساس نمودار هفتگی و ماهانه نیز با در نظر گرفتن سیگنال‌های قوی در بازارهای تکی به‌طور قابل‌توجهی متمایل به نتایج مطلوب بود. هیچ‌گونه موفقیتی در آزمایش‌ها بر اساس نمودارهای هفتگی و ماهانه نیز مشاهده نشد. به‌منظور بهبود نتایج، باید بهینه‌سازی انجام شود. اول‌ازهمه، می‌توان حد ضرر تعریف کرد که در اینجا صرف‌نظر شده بود. تعیین حد ضرر می‌تواند زیان را محدود کند و ما را از رکود عمیق محافظت کند. در ادامه کار، تعدیل هفته معاملاتی ۶ روزه به هفته ۵ روزه فعلی معاملات روزانه می‌تواند مفید باشد.

آزمایش‌های مبتنی بر نمودارهای هفتگی و ماهانه با استراتژی‌های اصلی اجرا شد. دوباره تأکید می‌کنیم، عوض کردن اندیکاتورها می‌تواند به دستیابی نتایج مطلوب‌تر کمک کند.